



ODDO BHF
ASSET MANAGEMENT

Jahresbericht

ODDO BHF Green Bond

30. September 2023

INHALT

JAHRESBERICHT 30.9.2023

Tätigkeitsbericht	2
Vermögensübersicht	7
Vermögensaufstellung	8
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen	18
ODDO BHF Green Bond CN-EUR	21
Ertrags- und Aufwandsrechnung	21
Entwicklung des Fondsvermögens	22
Verwendungsrechnung	22
Vergleichende Übersicht über die letzten 3 Geschäftsjahre	22
ODDO BHF Green Bond CR-EUR	23
Ertrags- und Aufwandsrechnung	23
Entwicklung des Fondsvermögens	24
Verwendungsrechnung	24
Vergleichende Übersicht über die letzten 3 Geschäftsjahre	24
ODDO BHF Green Bond DI-EUR	25
Ertrags- und Aufwandsrechnung	25
Entwicklung des Fondsvermögens	26
Verwendungsrechnung	26
Vergleichende Übersicht über die letzten 3 Geschäftsjahre	26
ODDO BHF Green Bond DP-EUR	27
Ertrags- und Aufwandsrechnung	27
Entwicklung des Fondsvermögens	28
Verwendungsrechnung	28
Vergleichende Übersicht über die letzten 3 Geschäftsjahre	28
Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten	34
Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers	44

TÄTIGKEITSBERICHT

AUSGANGSLAGE

Die Kombination aus hartnäckig hohen Inflationszahlen und einer robusten Konjunktur, zwang die Zentralbanken in den USA und Europa zu einer scharfen Wende in der Geldpolitik. Mit zehn Zinserhöhungen in Folge erhöhte die EZB den Leitzins auf 4,5 Prozent. Das höhere Zinsniveau belastete zunächst vor allem den Immobilienmarkt, wirkte sich im Laufe des Berichtsjahrs aber auch auf andere Wirtschaftssektoren aus. Das Wachstum verlangsamte sich und die Aussichten trübten sich zunehmend ein. Auch das unter einer Immobilienkrise leidende China verzeichnete rückläufige Wachstumszahlen. Aufgrund seiner starken Exportabhängigkeit zählt Deutschland zu den Schlusslichtern beim Wirtschaftswachstum unter den Industriestaaten. Trotz des konjunkturellen Gegenwinds profitierten die Aktienmärkte, vornehmlich die Technologiewerte, von dem mit dem Thema KI verbundenen Kursfantasien. Die Rallye verlor erst im dritten Quartal an Schwung. Nachdem Anleihen 2022 unter der rasanten Zinswende und sich ausweitenden Risikoprämien gelitten hatten, waren sie im Berichtszeitraum wieder gefragt, weshalb zahlreiche Unternehmen Neuemissionen begaben. Die Erwartungen auf ein baldiges Ende des Zinserhöhungszyklus und erste Zinssenkungen wurden aber enttäuscht, so dass die Renditen langlaufender Staatsanleihen zuletzt weiter anstiegen.

ODDO BHF Green Bond

Das Kapitalmarktumfeld im zurückliegenden Geschäftsjahr blieb schwierig für Renten. Die konjunkturelle Entwicklung verlief besser als vor einem Jahr befürchtet, unterstützt durch einen milden Winter und eine zumindest vorübergehende Entspannung der Energieversorgungssituation in Europa. Gleichzeitig blieben Inflationsraten hartnäckig hoch, zwangen Zentralbanken die Leitzinsen weiter anzuheben und somit den Druck auf den Rentenmarkt weiter zu erhöhen. In diesem Umfeld setzte sich der Anstieg unterliegender Renditen weiter fort und erreichte neue Höchststände insbesondere für längere Laufzeiten. Risikoaufschläge auf der anderen Seite kamen durch die besser als erwartete konjunkturelle Entwicklung deutlich herunter.

Im Geschäftsjahr war das Marktumfeld aufgrund exogener Ereignisse teilweise erneut volatil. Auch für das kommende Geschäftsjahr sind Belastungen durch volatile Marktverhältnisse und exogene Faktoren, die sich auf die Entwicklung des Sondervermögens auswirken, nicht auszuschließen.

KOMMENTIERUNG DES VERÄUSSERUNGSERGEBNISSES

Für den Anleger ist immer die gesamte Wertentwicklung des Fonds relevant. Diese speist sich aus mehreren Quellen wie den aktuellen Bewertungen der Wertpapiere und derivativen Instrumente, Zinsen und Dividenden sowie dem Ergebnis der Veräußerungsgeschäfte. Veräußerungsgeschäfte erfolgen grundsätzlich aus taktischen und strategischen Überlegungen des Fondsmanagements. Dabei können Wertpapiere und Derivate auch mit Verlust veräußert werden, beispielsweise um das Portefeuille vor weiteren erwarteten Wertminderungen zu schützen oder um die Liquidität des Fonds sicherzustellen.

Durch die im Berichtszeitraum des Fonds veräußerten Positionen ergaben sich per Saldo Verluste, die durch Renten entstanden.

WESENTLICHE RISIKEN DES SONDERVERMÖGENS IM BERICHTSZEITRAUM

Die nachfolgend dargestellten Risiken sind mit einer Anlage in Investmentvermögen typischerweise verbunden. Sie können sich nachteilig auf den Nettoinventarwert, den Kapitalerhalt oder die Erträge in der angestrebten Haltedauer auswirken. Die aktuelle Covid-19-Krise kann die Auswirkungen der genannten Risiken noch verstärken, wenn ökonomische Folgen diese Risiken zusätzlich nachteilig beeinflussen.

ZINSÄNDERUNGSRISIKO

Die Wertentwicklung des Fonds ist abhängig von der Entwicklung des Marktzinses. Zinsänderungen haben direkte Auswirkungen auf die Vorteilhaftigkeit eines verzinslichen Vermögensgegenstandes im Vergleich zu alternativen Instrumenten und somit auf die Bewertung des Vermögensgegenstandes und den Erfolg der Kapitalanlage. Zinsänderungen am Markt können gegebenenfalls dazu führen, dass keine Wertsteigerung erzielt werden kann.

MARKTRISIKEN

Die Kurs- oder Marktentwicklung von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den lokalen, wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen beeinflusst wird. Auf die allgemeine Kursentwicklung, insbesondere an einer Börse, können auch irrationale Faktoren wie Stimmungen, Meinungen und Gerüchte einwirken.

OPERATIONELLE RISIKEN EINSCHLIESSLICH VERWAHRISIKEN

Fehler und Missverständnisse bei der Verwaltung und Verwahrung können die Wertentwicklung des Fonds beeinträchtigen.

WÄHRUNGSRISIKEN

Der Fonds legt seine Mittel auch außerhalb des Euro-Raums an. Der Wert der Währungen dieser Anlagen gegenüber dem Euro kann fallen.

RISIKEN AUS DEM EINSATZ DERIVATIVER INSTRUMENTE

Derivate sind Finanztermingeschäfte, die sich auf Basiswerte wie Aktien, Anleihen, Zinsen, Indizes und Rohstoffe beziehen und von deren Wertentwicklung abhängig sind. Der Fonds darf derivative Instrumente zur Absicherung oder Wertsteigerung des Fondsvermögens einsetzen. Je nach Wertentwicklung des Basiswertes können dabei Verluste entstehen. Der Kontrahent für ein Derivatgeschäft kann ausfallen. Gegebenenfalls erhaltene Sicherheiten reichen im Verwertungsfall möglicherweise nicht zur Deckung von Verlusten aus.

RISIKEN AUS DERIVATEEINSATZ

Der Fonds darf Derivategeschäfte zu den in der "Anlagepolitik" genannten Zwecken einsetzen. Hierdurch ist eine Hebelung (Leverage) des Fondsvermögens möglich. Dadurch erhöhte Chancen gehen mit erhöhten Verlustrisiken einher. Durch eine Absicherung mittels Derivaten gegen Verluste können sich auch die Gewinnchancen des Fonds verringern.

LIQUIDITÄTSRISIKO

Für den Fonds dürfen auch Vermögensgegenstände erworben werden, die nicht zum amtlichen Markt an einer Börse zugelassen oder in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind. Auch für börsennotierte Vermögensgegenstände kann wenig Liquidität vorhanden oder in bestimmten Marktphasen eingeschränkt sein. Der Erwerb derartiger Vermögensgegenstände ist mit der Gefahr verbunden, dass es zu Problemen bei der Weiterveräußerung der Vermögensgegenstände an Dritte kommen kann, oder dass die Kurse aufgrund eines Verkäuferüberhangs sinken.

BONITÄTSRISIKEN

Der Fonds legt sein Vermögen vor allem in Anleihen an. Nimmt die Kreditwürdigkeit einzelner Aussteller ab oder werden diese zahlungsunfähig, so fällt der Wert der entsprechenden Anleihen.

KREDITRISIKEN

Der Fonds kann einen wesentlichen Teil seines Vermögens in Staats- und Unternehmensanleihen anlegen. Deren Aussteller können zahlungsunfähig werden, wodurch die Anleihen ihren Wert ganz oder teilweise verlieren. Darüber hinaus können im Fonds befindliche Anleihen Restrukturierungsklauseln enthalten. Dadurch können Gläubiger dieser Anleihen auch gegen ihren Willen z. B. einem Verzicht auf Zinsen oder Kapital ausgesetzt sein.

ADRESSENAUSFALLRISIKEN

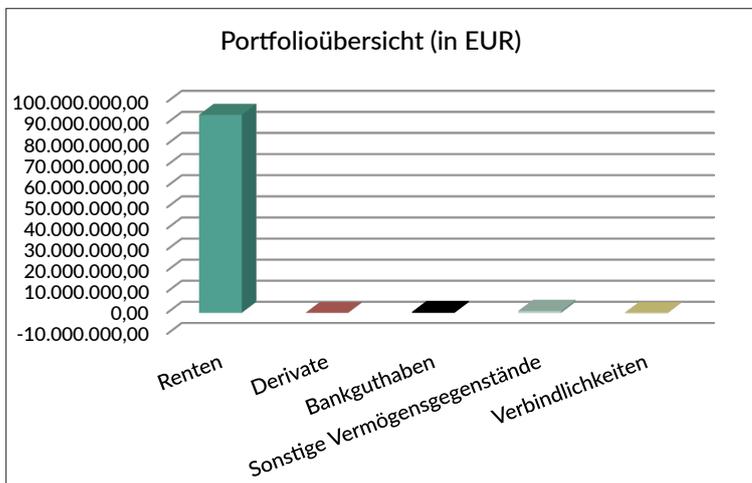
Durch den Ausfall eines Ausstellers oder eines Vertragspartners, gegen den der Fonds Ansprüche hat, können für den Fonds Verluste entstehen.

RISIKO DURCH ZENTRALE KONTRAHENTEN

Ein zentraler Kontrahent (Central Counterparty - CCP) tritt als zwischengeschaltete Institution in bestimmte Geschäfte für den Fonds ein, insbesondere in Geschäfte über derivative Finanzinstrumente. In diesem Fall wird er als Käufer gegenüber dem Verkäufer und als Verkäufer gegenüber dem Käufer tätig. Ein CCP sichert sich gegen das Risiko, dass seine Geschäftspartner die vereinbarten Leistungen nicht erbringen können, durch eine Reihe von Schutzmechanismen ab, die es ihm jederzeit ermöglichen, Verluste aus den eingegangenen Geschäften auszugleichen (z. B. durch Besicherungen). Es kann trotz dieser Schutzmechanismen nicht ausgeschlossen werden, dass ein CCP seinerseits überschuldet wird und ausfällt, wodurch auch Ansprüche der Gesellschaft für den Fonds betroffen sein können. Hierdurch können Verluste für den Fonds entstehen.

Portfolioübersicht

Die Struktur des Portfolios des OGAW-Sondervermögen ODDO BHF Green Bond im Hinblick auf die Anlageziele zum Geschäftsjahresende 30. September 2023:

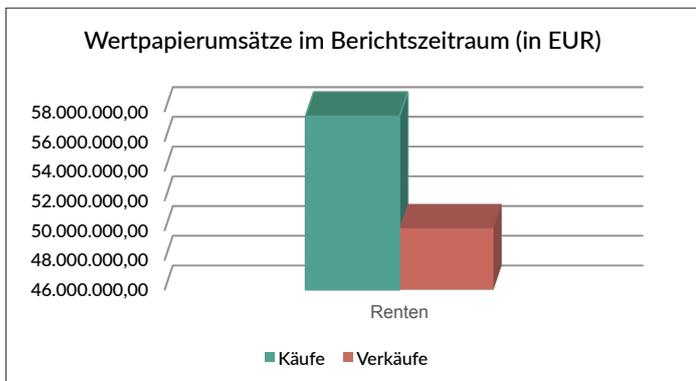


Portfolioübersicht (in EUR)

Bezeichnung	Betrag
Renten	93.831.797,14
Derivate	-5.396,89
Bankguthaben	464.950,55
Sonstige Vermögensgegenstände	910.760,40
Verbindlichkeiten	-69.885,50
Fondsvermögen	95.132.225,70

Übersicht über die Anlagegeschäfte

Darstellung des Transaktionsvolumens während des Berichtszeitraumes vom 1. Oktober 2022 bis 30. September 2023:



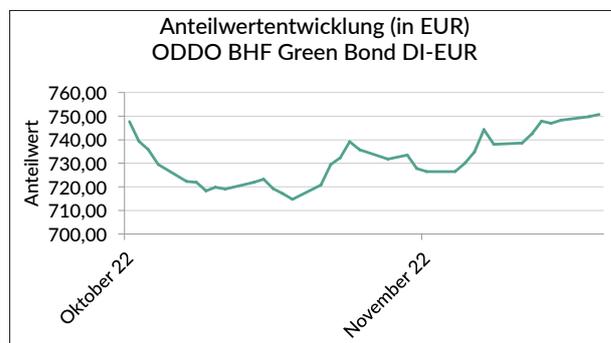
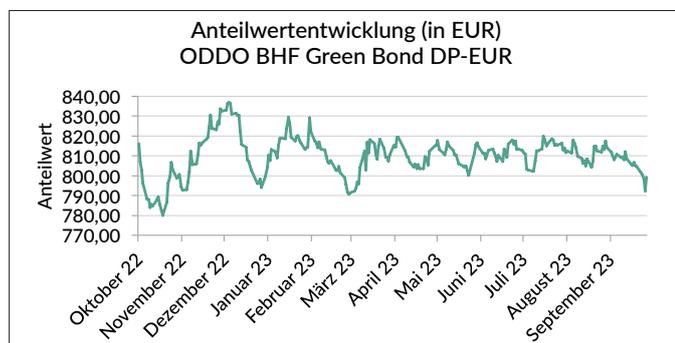
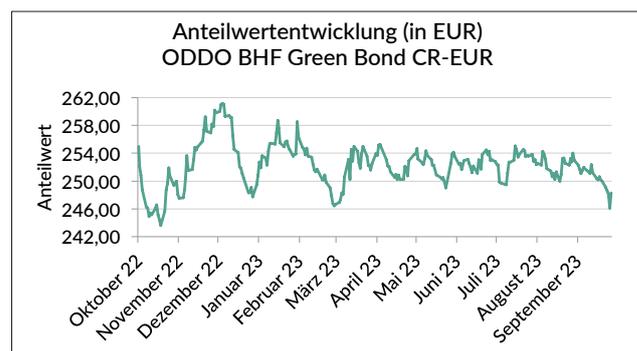
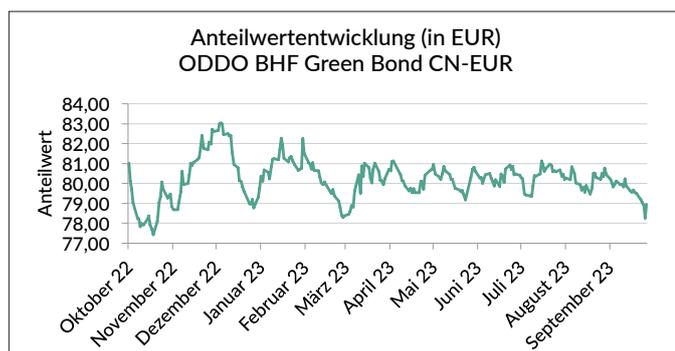
Wertpapierumsätze im Berichtszeitraum (in EUR)

Bezeichnung	Käufe	Verkäufe
Renten	57.659.822,15	50.133.776,34

Übersicht über die Wertentwicklung

Im Berichtszeitraum vom 1. Oktober 2022 bis 30. September 2023 war die Netto-Performance der Anteilsklassen wie folgt:

ODDO BHF Green Bond CN-EUR	bei	-049% ¹⁾
ODDO BHF Green Bond CR-EUR	bei	-060% ¹⁾
ODDO BHF Green Bond DP-EUR	bei	+0,02% ¹⁾
ODDO BHF Green Bond DI-EUR	bei	+2,52%



¹⁾ Die frühere Wertentwicklung ist keine Garantie für die künftige Entwicklung des Fonds. Die Berechnung erfolgte nach der BVI-Methode ohne Berücksichtigung von Ausgabeaufschlägen oder Rücknahmeabschlägen.

Vermögensübersicht zum 30.9.2023

Anlageschwerpunkte	Tageswert in EUR	In % vom Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	95.202.111,20	100,07
1. Anleihen	93.831.797,14	98,63
< 1 Jahr	335.410,00	0,35
>= 1 Jahr bis < 3 Jahre	11.899.584,21	12,51
>= 3 Jahre bis < 5 Jahre	22.944.010,57	24,12
>= 5 Jahre bis < 10 Jahre	32.108.115,15	33,75
>= 10 Jahre	26.544.677,21	27,90
2. Derivate	-5.396,89	-0,01
3. Bankguthaben	464.950,55	0,49
4. Sonstige Vermögensgegenstände	910.760,40	0,96
II. Verbindlichkeiten	-69.885,50	-0,07
III. Fondsvermögen	95.132.225,70	100,00

Vermögensaufstellung zum 30.9.2023

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 30.9.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE						88.955.753,94	93,51
Verzinsliche Wertpapiere						88.955.753,94	93,51
2,3750 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 22(27) XS2487054004	EUR	1.100	200	0	93,508 %	1.028.590,20	1,08
4,0000 % ABN AMRO Bank N.V. EO-Non-Preferred MTN 23(28) XS2575971994	EUR	400	400	0	98,324 %	393.295,60	0,41
3,9000 % Adif - Alta Velocidad EO-Med.-T, Nts 23(33) ES0200002089	EUR	700	700	0	97,268 %	680.876,00	0,72
4,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argent. EO-Preferred MTN 22(29) XS2545206166	EUR	500	500	0	100,273 %	501.365,00	0,53
1,1250 % Banco Santander S.A. EO-Med-T. Nts 20(27) XS2194370727	EUR	400	0	0	89,698 %	358.790,40	0,38
0,3000 % Banco Santander S.A. EO-Preferred MTN 19(26) XS2063247915	EUR	900	300	0	89,783 %	808.050,60	0,85
3,8750 % Banque Stellantis France S.A. EO-Med.-Term Notes 23(23/26) FR001400F6V1	EUR	400	400	0	99,009 %	396.036,00	0,42
1,2500 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 18(33) Ser. 86 BE0000346552	EUR	2.050	200	400	82,979 %	1.701.077,70	1,79
2,7500 % Belgien, Königreich EO-Obl. Lin. 22(39) BE0000356650	EUR	1.400	1.400	0	88,085 %	1.233.191,40	1,30
0,6250 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.18(25) Ser.211 DE000BHYOGC3	EUR	700	0	0	93,947 %	657.628,30	0,69
0,0100 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.19(27) DE000BHYOGL4	EUR	900	0	300	87,817 %	790.349,40	0,83
0,0100 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.20(28) DE000BHYOGD1	EUR	400	0	0	85,059 %	340.235,60	0,36
0,0100 % Berlin Hyp AG Hyp.-Pfandbr. v.20(30) DE000BHYOGX9	EUR	205	0	0	78,971 %	161.890,96	0,17
0,5000 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(27/28) FR0014006NI7	EUR	400	0	0	86,736 %	346.945,60	0,36
0,5000 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 19(25/26) FR0013465358	EUR	200	0	0	94,001 %	188.001,40	0,20
0,3750 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 20(26/27) FR00140005J1	EUR	1.300	900	0	88,574 %	1.151.463,30	1,21
4,2500 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 23(30/31) FR001400H9B5	EUR	300	300	0	97,427 %	292.280,40	0,31

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 30. September 2023

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 30.9.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)							
Verzinsliche Wertpapiere							
0,5000 % BPCE S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 22(27/28) FR0014007LL3	EUR	1.300	1.300	0	87,652 %	1.139.472,10	1,20
1,7500 % BPCE SFH EO-M.-T.Obl.Fin.Hab.22(32) FR001400AJW4	EUR	400	0	0	85,735 %	342.940,00	0,36
0,1000 % Bque Fédérative du Cr. Mutuel EO-Preferred MTN 20(27) FR00140003P3	EUR	1.500	1.000	0	85,523 %	1.282.845,00	1,35
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.20 (30) DE0001030708	EUR	61	600	600	83,376 %	50.750,85	0,05
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.21 (50) Grüne DE0001030724	EUR	1.800	1.000	1.700	46,115 %	830.075,40	0,87
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.v.20(25) DE0001030716	EUR	1.900	2.900	1.000	94,049 %	1.786.936,70	1,88
1,3000 % Bundesrep.Deutschland Bundesobl.v.22(27) Grüne DE0001030740	EUR	700	1.400	700	94,523 %	661.661,00	0,70
0,1000 % Caisse Francaise d.Financ.Loc. EO-M.-T.Obl.Foncières 19(29) FR0013459757	EUR	300	0	0	80,969 %	242.905,80	0,26
0,7500 % Commerzbank AG FLR-MTN Ser.965 v.20(25/26) DE000CB0HRQ9	EUR	200	0	0	94,238 %	188.476,00	0,20
5,2500 % Commerzbank AG FLR-MTN Serie 1018 v.23(28/29) DE000CZ439B6	EUR	200	200	0	99,802 %	199.604,80	0,21
0,0500 % Crédit Agricole Home Loan SFH EO-Med.-T.Obl.Fin.Hab.19(29) FR0013465010	EUR	2.100	700	0	80,446 %	1.689.355,50	1,78
0,3750 % Crédit Agricole S.A. EO-Non-Preferred MTN 19(25) XS2067135421	EUR	600	200	0	92,746 %	556.473,60	0,58
3,2500 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.22(27/28) DE000DL19WU8	EUR	900	1.200	600	93,149 %	838.341,00	0,88
4,5000 % DNB Bank ASA EO-FLR Med.-T. Nts 23(27/28) XS2652069480	EUR	700	700	0	100,509 %	703.565,10	0,74
3,6250 % DNB Bank ASA EO-FLR Non-Pref. MTN 23(26/27) XS2588099478	EUR	917	917	0	98,452 %	902.808,51	0,95
0,3750 % DNB Bank ASA EO-FLR Preferred MTN 22(27/28) XS2432567555	EUR	732	0	500	88,623 %	648.720,36	0,68
0,6250 % DNB Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 18(25) XS1839888754	EUR	1.000	0	0	94,680 %	946.798,00	1,00
0,0100 % DNB Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 21(31) XS2289593670	EUR	400	0	0	76,923 %	307.692,40	0,32

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 30. September 2023

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 30.9.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)							
Verzinsliche Wertpapiere							
3,3750 % DZ HYP AG MTN-Hyp.Pfbr.1263 23(28) DE000A351XK8	EUR	400	400	0	99,470 %	397.881,60	0,42
4,0000 % E.ON SE Medium T. Nts v.23(33/33) XS2673547746	EUR	400	400	0	97,487 %	389.947,20	0,41
3,8750 % E.ON SE Medium T. Nts v.23(34/35) XS2574873183	EUR	500	700	200	95,018 %	475.088,00	0,50
4,4960 % EDP - Energias de Portugal SA EO-FLR Securities 19(24/79) PTEDPKOM0034	EUR	300	0	0	99,375 %	298.125,00	0,31
3,8750 % EDP Finance B.V. EO-M.-T. Nts 22(22/30) XS2542914986	EUR	435	435	0	98,144 %	426.928,14	0,45
4,7500 % Electricité de France (E.D.F.) EO-Med.-Term Notes 22(22/34) FR001400D6O8	EUR	600	600	0	99,159 %	594.954,00	0,63
3,2500 % Engie S.A. EO-FLR Notes 19(24/Und.) FR0013398229	EUR	800	200	0	97,412 %	779.295,20	0,82
1,7500 % Engie S.A. EO-Medium-T. Nts 20(20/28) FR0013504677	EUR	400	0	400	91,177 %	364.706,40	0,38
3,5000 % Engie S.A. EO-Medium-T. Nts 22(22/29) FR001400A1H6	EUR	400	400	0	97,141 %	388.563,20	0,41
3,6250 % Engie S.A. EO-Medium-T. Nts 23(23/30) FR001400F1G3	EUR	400	400	0	97,310 %	389.240,80	0,41
4,5000 % Engie S.A. EO-Medium-T. Nts 23(23/42) FR001400KHI6	EUR	300	300	0	96,571 %	289.712,40	0,30
4,2500 % Engie S.A. EO-Medium-T. Nts 23(23/43) FR001400F1M1	EUR	300	300	0	93,543 %	280.628,70	0,29
3,2790 % Eurogrid GmbH MTN v.22(22/31) XS2527319979	EUR	400	0	0	93,914 %	375.655,60	0,39
0,4000 % Europäische Union EO-Med.-T. Nts 21(37) EU000A3K4C42	EUR	2.230	400	0	66,399 %	1.480.699,93	1,56
2,7500 % Europäische Union EO-Med.-T. Nts 22(33) EU000A3K4DW8	EUR	900	900	0	94,536 %	850.824,00	0,89
1,2500 % Europäische Union EO-Med.-T. Nts 22(43) EU000A3K4DG1	EUR	1.410	0	0	65,327 %	921.103,65	0,97
2,6250 % Europäische Union EO-Med.-T. Nts 22(48) EU000A3K4DM9	EUR	500	0	0	82,066 %	410.331,50	0,43
1,5000 % European Investment Bank EO-Med.-Term Notes 17(47) XS1641457277	EUR	500	0	0	65,441 %	327.205,00	0,34
1,0000 % European Investment Bank EO-Med.-Term Notes 19(42) XS1980857319	EUR	1.700	0	0	63,241 %	1.075.088,50	1,13
0,0100 % European Investment Bank EO-Med.-Term Notes 20(35) XS2194790262	EUR	1.300	0	0	65,699 %	854.089,60	0,90
0,0100 % European Investment Bank EO-Med.-Term Notes 21(30) XS2314675997	EUR	400	0	100	79,302 %	317.208,00	0,33
1,5000 % European Investment Bank EO-Med.-Term Notes 22(32) XS2484093393	EUR	1.000	0	0	86,085 %	860.845,00	0,90

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 30. September 2023

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 30.9.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)							
Verzinsliche Wertpapiere							
1,7500 % Frankreich EO-OAT 17(39) FR0013234333	EUR	5.800	0	1.700	77,655 %	4.503.961,00	4,73
2,5000 % Hera S.p.A. EO-Med.-T. Nts 22(22/29) XS2485360981	EUR	700	0	0	91,576 %	641.033,40	0,67
4,8750 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-FLR M.-T. Nts 23(23/Und.) XS2580221658	EUR	300	300	0	96,557 %	289.670,40	0,30
0,9500 % Ile-de-France Mobilités EO-Med.-Term Notes 22(32) FR0014008CQ9	EUR	1.000	0	0	80,736 %	807.360,00	0,85
2,1250 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 22(25/26) XS2483607474	EUR	700	300	0	96,214 %	673.498,00	0,71
0,8750 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 21(27/32) XS2350756446	EUR	400	400	0	85,069 %	340.276,80	0,36
4,1250 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.T.Nts 22(28/33) XS2524746687	EUR	400	400	0	94,366 %	377.463,60	0,40
0,0100 % ING-DiBa AG Hyp.-Pfandbrief v.21(28) DE000A1KRJV6	EUR	1.200	400	0	84,227 %	1.010.726,40	1,06
4,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-Preferred Med.-T.Nts 23(26) XS2625195891	EUR	200	400	200	99,243 %	198.485,40	0,21
1,9500 % Iren S.p.A. EO-Med.-Term Nts 18(25/25) XS1881533563	EUR	560	0	0	95,655 %	535.670,24	0,56
3,0000 % Irland EO-Treasury Bonds 23(43) IE000GVLBXU6	EUR	1.110	1.110	0	91,891 %	1.019.984,55	1,07
4,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 22(35) IT0005508590	EUR	3.200	3.200	0	92,765 %	2.968.480,00	3,12
4,0000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 23(31) IT0005542359	EUR	500	500	0	96,659 %	483.295,00	0,51
4,2500 % John.Cont.Intl/Tyco F.+Sec.F. EO-Notes 23(23/35) XS2626007939	EUR	535	635	100	96,199 %	514.666,26	0,54
0,1250 % KommuneKredit EO-Med.-T. Nts 20(40) XS2226280084	EUR	300	0	0	55,590 %	166.770,00	0,18
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.20(28) XS2209794408	EUR	4.100	0	0	84,965 %	3.483.565,00	3,66
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.21(29) XS2331327564	EUR	900	0	100	83,037 %	747.335,70	0,79
1,9000 % Landwirtschaftliche Rentenbank Med.T.Nts. Ser.1222 v.22(32) XS2500341990	EUR	500	0	0	89,021 %	445.105,00	0,47
0,0000 % Landwirtschaftliche Rentenbank Med.T.Nts.v.21(31) XS2359292955	EUR	2.100	0	0	77,426 %	1.625.935,50	1,71
0,3750 % Lb.Hessen-Thüringen GZ MTN IHS S.H345 v.21(29) XS2346124410	EUR	500	0	0	80,708 %	403.540,00	0,42

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 30. September 2023

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 30.9.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)							
Verzinsliche Wertpapiere							
1,2500 % Münchener Hypothekenbank MTN-HPF Ser.1989 v.22(30) DE000MHB30J1	EUR	629	0	0	87,529 %	550.554,89	0,58
0,0500 % Municipality Finance PLC EO-Med.-Term Notes 19(29) XS2023679843	EUR	700	0	300	82,428 %	576.996,00	0,61
0,1900 % National Grid Electr.Trans.PLC EO-Medium Term Nts 20(20/25) XS2104915033	EUR	235	0	0	95,073 %	223.420,85	0,23
0,2500 % National Grid PLC EO-M. T. Nts 21(21/28) XS2381853279	EUR	468	0	0	82,315 %	385.233,73	0,40
3,8750 % National Grid PLC EO-M. T. Nts 23(23/29) XS2575973776	EUR	500	500	0	97,525 %	487.625,50	0,51
3,8750 % Neste Oyj EO-Med.-Term Nts 23(23/29) XS2598649254	EUR	600	600	0	98,919 %	593.515,80	0,62
0,5000 % Niederlande EO-Anl. 19(40) NL0013552060	EUR	3.700	300	950	65,341 %	2.417.613,30	2,54
1,1250 % Nordea Bank Abp EO-Non Preferred MTN 22(27) XS2443893255	EUR	200	0	200	90,928 %	181.856,60	0,19
3,5000 % Nordea Mortgage Bank PLC EO-Med.-Term Cov. Bds 23(26) XS2673972795	EUR	677	677	0	99,547 %	673.931,84	0,71
0,0000 % NRW.BANK MTN-IHS Ausg. 0AH v.19(29) DE000NWBOAH9	EUR	1.300	0	0	81,771 %	1.063.023,00	1,12
5,2500 % Orsted A/S EO-FLR Notes 22(22/3022) XS2563353361	EUR	558	558	0	96,250 %	537.075,00	0,56
2,2500 % Orsted A/S EO-FLR Secs 17(24/17) XS1720192696	EUR	400	400	0	95,860 %	383.438,38	0,40
1,5000 % Orsted A/S EO-Med.-T. Notes 17(17/29) XS1721760541	EUR	500	200	0	86,020 %	430.097,50	0,45
2,2500 % Orsted A/S EO-Med.-T. Nts 22(22/28) XS2490471807	EUR	387	0	0	92,301 %	357.206,42	0,38
3,2500 % Orsted A/S EO-Med.-T. Nts 22(22/31) XS2531569965	EUR	500	500	0	93,258 %	466.290,50	0,49
2,8750 % Orsted A/S EO-Med.-T. Nts 22(22/33) XS2490472102	EUR	400	400	0	88,380 %	353.519,20	0,37
1,8500 % Österreich, Republik EO-M.-T. Nts 22(49) AT0000A2Y8G4	EUR	1.196	0	0	70,682 %	845.357,92	0,89
2,9000 % Österreich, Republik EO-M.-T. Nts 23(29) AT0000A33SH3	EUR	1.048	1.248	200	98,385 %	1.031.072,70	1,08
0,3750 % Prologis Euro Finance LLC EO-Notes 20(20/28) XS2112475509	EUR	800	200	0	84,724 %	677.788,80	0,71
1,5000 % Prologis Euro Finance LLC EO-Notes 22(22/34) XS2439004685	EUR	400	400	0	73,052 %	292.207,20	0,31
0,3500 % Régie Auton.Transp. Par.(RATP) EO-Medium-T. Notes 19(29) FR0013426731	EUR	2.000	0	0	83,331 %	1.666.620,00	1,75
4,0000 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Non-Preferred MTN 22(26) XS2553798443	EUR	600	600	0	99,345 %	596.070,00	0,63

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 30. September 2023

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 30.9.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)							
Verzinsliche Wertpapiere							
4,1250 % Skandinaviska Enskilda Banken EO-Preferred MTN 23(27) XS2643041721	EUR	400	400	0	100,250 %	400.998,80	0,42
0,8750 % SNCF Réseau S.A. EO-Med.-T.-Nts 19(29) XS1938381628	EUR	400	400	0	87,032 %	348.128,00	0,37
1,1250 % Société du Grand Paris EO-Med.-Term Nts 19(34) FR0013409612	EUR	1.700	0	0	76,362 %	1.298.154,00	1,36
1,7000 % Société du Grand Paris EO-Med.-T. Nts 19(50) FR0013422383	EUR	600	0	0	60,262 %	361.570,80	0,38
0,0000 % Société du Grand Paris EO-Med-Term Notes 20(30) FR00140005B8	EUR	900	200	0	77,630 %	698.668,20	0,73
0,7000 % Société du Grand Paris EO-Med.-Term Notes 20(60) FR00140005R4	EUR	500	0	0	33,951 %	169.753,00	0,18
3,5000 % Société du Grand Paris EO-Med.-Term Notes 23(43) FR001400F6X7	EUR	500	500	0	90,662 %	453.311,50	0,48
0,8750 % Société Générale S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 20(27/28) FR0013536661	EUR	800	800	0	86,441 %	691.529,60	0,73
1,0000 % Spanien EO-Bonos 21(42) ES0000012J07	EUR	1.500	500	400	57,748 %	866.215,50	0,91
0,0100 % SR-Boligkreditt A.S. EO-Mortg. Covered MTN 19(26) XS2063288190	EUR	933	0	0	89,665 %	836.571,65	0,88
0,8750 % SSE PLC EO-Med.-T. Notes 17(17/25) XS1676952481	EUR	480	0	0	94,323 %	452.751,84	0,48
2,8750 % SSE PLC EO-Med.-T. Notes 22(22/29) XS2510903862	EUR	1.041	900	0	94,100 %	979.577,88	1,03
3,1250 % Stadshypotek AB EO-Med.-T. Hyp.-Pfandbr.23(28) XS2607344079	EUR	400	400	0	97,854 %	391.416,80	0,41
2,8750 % Statkraft AS EO-Med.-T. Nts 22(22/29) XS2532312548	EUR	200	0	0	95,449 %	190.898,60	0,20
3,5000 % Statnett SF EO-Med.-T. Notes 23(23/33) XS2631835332	EUR	421	421	0	96,637 %	406.840,93	0,43
2,3750 % Stedin Holding N.V. EO-Med.-T. Nts 22(22/30) XS2487016250	EUR	1.100	600	0	90,414 %	994.555,10	1,05
2,3740 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Notes 20(20/Und.) XS2207430120	EUR	1.356	1.100	0	94,353 %	1.279.421,26	1,34
2,9950 % TenneT Holding B.V. EO-FLR Securit. 17(24/Und.) XS1591694481	EUR	340	0	0	98,650 %	335.410,00	0,35
3,8750 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 22(22/28) XS2549543143	EUR	310	310	0	100,989 %	313.065,59	0,33
2,1250 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 22(22/29) XS2478299204	EUR	800	700	200	93,450 %	747.602,40	0,79

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 30. September 2023

Gattungsbezeichnung ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Bestand 30.9.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)							
Verzinsliche Wertpapiere							
4,7500 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 22(22/42) XS2549715618	EUR	700	700	0	105,861 %	741.023,50	0,78
0,0100 % UBS AG EO-Medium-Term Nts 21(26) XS2358287238	EUR	400	0	0	89,299 %	357.194,00	0,38
5,8500 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 22(26/27) XS2555420103	EUR	600	1.000	400	102,144 %	612.864,00	0,64
0,0500 % Vattenfall AB EO-Med.-T. Nts 20(20/25) XS2133390521	EUR	400	0	0	92,425 %	369.699,60	0,39
5,0000 % Vonovia SE Med. T. Notes v.22(22/30) DE000A30VQB2	EUR	700	1.400	700	98,757 %	691.296,90	0,73
3,7500 % European Investment Bank DL-Nts 23(33) US298785JV96	USD	1.200	1.200	0	91,960 %	1.042.285,71	1,10
AN ORGANISIERTEN MÄRKTEN ZUGELASSENE ODER IN DIESE EINBEZOGENE WERTPAPIERE						4.876.043,20	5,13
Verzinsliche Wertpapiere						4.876.043,20	5,13
6,2500 % ABEILLE VIE SA d.Ass.V.e.d.C. EO-Obl. 22(22/33) FR001400CHR4	EUR	300	500	200	98,656 %	295.968,00	0,31
3,8750 % Amprion GmbH MTN v. 23(28/28) DE000A3514E6	EUR	500	500	0	99,082 %	495.408,00	0,52
2,5000 % Digital Euro Finco LLC EO-Notes 19(19/26) Reg.S XS1891174341	EUR	600	400	0	94,935 %	569.607,00	0,60
0,6250 % Digital Intrepid Holding B.V. EO-Bonds 21(21/31) Reg.S XS2280835260	EUR	300	200	700	71,561 %	214.684,20	0,23
0,1250 % Hamburger Hochbahn AG Anl. v.21(30/31) XS2233088132	EUR	700	0	0	77,423 %	541.961,00	0,57
1,5750 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-FLR M.-T. Nts 21(21/Und.) XS2405855375	EUR	600	1.200	600	84,571 %	507.424,80	0,53
1,4500 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Notes 21(21/Und.) XS2295335413	EUR	400	0	0	86,973 %	347.890,80	0,37
3,2500 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Securit. 19(24/Und.) XS1890845875	EUR	700	0	0	97,546 %	682.820,60	0,72
0,0100 % Svenska Handelsbanken AB EO-Non-Preferred MTN 20(27) XS2265968284	EUR	1.000	400	0	84,903 %	849.034,00	0,89
2,6250 % Svenska Handelsbanken AB EO-Preferred MTN 22(29) XS2527451905	EUR	400	400	0	92,811 %	371.244,80	0,39
Summe Wertpapiervermögen ²⁾						93.831.797,14	98,63

²⁾ Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 30. September 2023

Gattungsbezeichnung	Markt	Bestand 30.9.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (FORTSETZUNG)							
DERIVATE (Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.)						-5.396,89	-0,01
Zins-Derivate						-6.200,00	-0,01
Forderungen/Verbindlichkeiten							
Zinsterminkontrakte						-6.200,00	-0,01
FUTURE EURO-BOBL 12.23 EUREX	185	EUR	500.000			-6.200,00	-0,01
Devisen-Derivate						803,11	0,00
Forderungen/Verbindlichkeiten							
Devisenterminkontrakte (Verkauf)						803,11	0,00
Offene Positionen							
USD/EUR 1,1 Mio.	OTC					803,11	0,00

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 30. September 2023

Gattungsbezeichnung	Bestand 30.9.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
BANKGUTHABEN, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds					464.950,55	0,49
Bankguthaben					464.950,55	0,49
EUR-Guthaben bei:						
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main					434.902,53	0,46
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen bei:						
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			NOK	1.672,30	148,44	0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			SEK	348,42	30,29	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen bei:						
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			AUD	710,89	433,35	0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			CAD	60,29	42,12	0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			GBP	1.316,77	1.518,07	0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			JPY	245.610,00	1.554,57	0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			MXN	10,54	0,57	0,00
The Bank of New York Mellon SA/NV, Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main			USD	27.866,95	26.320,61	0,03
Sonstige Vermögensgegenstände					910.760,40	0,96
Zinsansprüche					902.629,60	0,95
Einschüsse (Initial Margins)					8.130,80	0,01
Sonstige Verbindlichkeiten					-69.885,50	-0,07
Verwaltungsvergütung					-52.958,91	-0,06
Verwahrstellenvergütung					-2.008,78	0,00
Prüfungskosten					-8.975,34	-0,01
Veröffentlichungskosten					-5.942,47	-0,01
Fondsvermögen					95.132.225,70	100,00 ³⁾

ODDO BHF Green Bond CN-EUR

Anteilwert	EUR	78,96
Ausgabepreis	EUR	81,33
Rücknahmepreis	EUR	78,96
Anteile im Umlauf	Stück	7.231

ODDO BHF Green Bond CR-EUR

Anteilwert	EUR	248,28
Ausgabepreis	EUR	255,73
Rücknahmepreis	EUR	248,28
Anteile im Umlauf	Stück	345.487

ODDO BHF Green Bond DP-EUR

Anteilwert	EUR	799,26
Ausgabepreis	EUR	799,26
Rücknahmepreis	EUR	799,26
Anteile im Umlauf	Stück	10.990

³⁾ Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

FORTSETZUNG: Vermögensaufstellung zum 30. September 2023

Gattungsbezeichnung	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
---------------------	------	--------------------	--------------------------------

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der zuletzt festgestellten Kurse/Marktsätze bewertet.

Devisenkurse (in Mengennotiz)

Australische Dollar	AUD	1 EUR = 1,6404500	Mexikanischer Peso	MXN	1 EUR = 18,3995000
Kanadische Dollar	CAD	1 EUR = 1,4314000	Norwegische Krone	NOK	1 EUR = 11,2660000
Britisches Pfund	GBP	1 EUR = 0,8674000	Schwedische Krone	SEK	1 EUR = 11,5025000
Japanischer Yen	JPY	1 EUR = 157,9919500	US-Dollar	USD	1 EUR = 1,0587500

Marktschlüssel

Terminbörsen

185 = Eurex Deutschland

OTC = Over-the-Counter

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE				
Verzinsliche Wertpapiere				
0,8750 % Alliander N.V. EO-Medium-T. Notes 16(26/26)	XS1400167133	EUR	0	400
0,8750 % Alliander N.V. EO-Medium-T. Notes 19(19/32)	XS2014382845	EUR	0	277
0,3750 % Alliander N.V. EO-Medium-Term Nts 20(20/30)	XS2187525949	EUR	0	405
0,5000 % Allianz Finance II B.V. EO-Med.-Term Notes 21(33/33)	DE000A3KY359	EUR	0	300
4,7500 % Allianz SE FLR-Med.Ter.Nts.v.13(23/unb.)	DE000A1YCQ29	EUR	0	1.200
3,9410 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 14(24/Und.)	XS1134541306	EUR	0	400
3,7500 % AXA S.A. EO-Med.-Term Nts 22(22/30)	XS2537251170	EUR	243	243
0,6250 % Banco Santander S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 21(28/29)	XS2357417257	EUR	0	300
4,3750 % BNP Paribas S.A. EO-FLR Non-Pref. MTN 23(28/29)	FR001400DCZ6	EUR	300	300
1,1250 % BNP Paribas S.A. EO-Non-Preferred MTN 19(24)	FR0013405537	EUR	0	900
0,0000 % Bundesrep.Deutschland Anl.v.21 (2031) Grüne	DE0001030732	EUR	1.700	4.700
2,0000 % CNP Assurances S.A. EO-FLR Med.-T.Nts 19(30/50)	FR0013463775	EUR	500	500
1,2500 % Commerzbank AG MTN-IHS S.915 v.18(23)	DE000CZ40NG4	EUR	0	500
0,3750 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Med.-T. Nts 21(26/27)	XS2416413339	EUR	0	1.100
1,6250 % CPI PROPERTY GROUP S.A. EO-M.-T.Nts 19(19/27) Reg.S	XS2069407786	EUR	0	591
2,7500 % CPI PROPERTY GROUP S.A. EO-Medium-T. Nts 20(20/26)	XS2171875839	EUR	0	392
0,4500 % Credit Suisse AG EO-Medium-Term Notes 20(25)	XS2176686546	EUR	0	300
1,3750 % Deutsche Bank AG FLR-MTN v.20(25/26)	DE000DL19VD6	EUR	0	465
1,3000 % Deutsche Wohnen SE Anleihe v.21(21/41)	DE000A3H25Q2	EUR	0	300
0,3500 % E.ON SE Medium Term Notes v.19(29/30)	XS2047500926	EUR	300	300
1,0000 % E.ON SE Medium Term Notes v.20(25/25)	XS2152899584	EUR	0	517
0,3750 % E.ON SE Medium Term Notes v.20(27/27)	XS2103014291	EUR	0	600
0,8750 % E.ON SE Medium Term Notes v.22(24/25)	XS2463505581	EUR	0	179
5,9430 % EDP - Energias de Portugal SA EO-FLR M.-T. Nts 23(23/83)	PTEDP4OM0025	EUR	300	300
3,8750 % EDP - Energias de Portugal SA EO-Med.-T. Nts 23(23/28)	PTEDPUOM0008	EUR	200	200
1,1250 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Med.-Term Notes 18(18/26)	XS1750986744	EUR	0	800
1,5000 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Med.-Term Notes 19(19/25)	XS1937665955	EUR	0	400
0,8750 % ENEL Finance Intl N.V. EO-Med.-Term Notes 21(21/36)	XS2353182376	EUR	0	511
0,6250 % Enexis Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 20(20/32)	XS2190255211	EUR	200	551
0,3750 % Enexis Holding N.V. EO-Medium-Term Nts 21(21/33)	XS2331315635	EUR	1.200	1.200
1,5000 % Engie S.A. EO-FLR Notes 20(28/Und.)	FR0014000RR2	EUR	200	200
1,3750 % Engie S.A. EO-Medium-Term Nts 19(19/39)	FR0013428513	EUR	0	400
0,1500 % EUROFIMA EO-Medium-Term Notes 19(34)	XS2055744689	EUR	0	600
0,0500 % European Investment Bank EO-Med.-Term Notes 2022(29)	XS2439543047	EUR	300	300
0,5000 % Frankreich EO-OAT 21(44)	FR0014002JM6	EUR	0	1.400
1,5000 % HSBC Holdings PLC EO-FLR Med.-T. Nts 18(23/24)	XS1917601582	EUR	0	720
1,3750 % Iberdrola Finanzas S.A. EO-Medium-Term Nts 22(22/32)	XS2455983861	EUR	0	700
0,6250 % Icade S.A. EO-Obl. 21(21/31)	FR0014001IM0	EUR	0	400
1,0000 % Icade S.A. EO-Obl. 22(22/30)	FR0014007NF1	EUR	0	700
0,4000 % Ile-de-France Mobilités EO-Medium-Term Notes 21(31)	FR0014003OC5	EUR	0	500
1,6250 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 17(24/29)	XS1689540935	EUR	0	400
1,0000 % ING Groep N.V. EO-FLR Med.-Term Nts 19(25/30)	XS2079079799	EUR	0	400
2,5000 % ING Groep N.V. EO-Medium-Term Notes 18(30)	XS1909186451	EUR	0	200
5,8750 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Med.-T. Nts 19(24/29)	XS1958656552	EUR	0	200
5,0000 % Intesa Sanpaolo S.p.A. EO-FLR Non-Pref.MTN 23(27/28)	XS2592650373	EUR	561	561
2,7500 % Investor AB EO-Med.-Term Notes 2022(22/32)	XS2481287634	EUR	0	226

FORTSETZUNG: Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (Fortsetzung)				
Verzinsliche Wertpapiere				
1,5000 % Iren S.p.A. EO-Medium-Term Nts 17(27/27)	XS1704789590	EUR	0	300
1,3500 % Irland EO-Treasury Bonds 18(31)	IE00BFZRQ242	EUR	0	600
1,5000 % Italien, Republik EO-B.T.P. 21(45)	IT0005438004	EUR	0	700
0,2500 % KBC Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 21(26/27)	BE0002832138	EUR	0	600
1,5000 % KBC Groep N.V. EO-FLR Med.-T. Nts 22(25/26)	BE0002846278	EUR	0	400
0,3750 % KBC Groep N.V. EO-FLR Med.-T.Nts 20(26/27)	BE0974365976	EUR	0	200
2,0000 % Klépierre S.A. EO-Med.-Term Notes 20(20/29)	FR0013512233	EUR	0	300
0,0000 % Kreditanst.f.Wiederaufbau Med.Term Nts. v.21(31)	XS2388457264	EUR	500	500
3,7000 % Mercedes-Benz Int.Fin. B.V. EO-Medium-Term Notes 23(31)	DE000A3LH6U5	EUR	300	300
0,5000 % Nationale-Niederlande Bank NV EO-Med.-Term Notes 21(28)	XS2388449758	EUR	0	400
4,1250 % Naturgy Finance B.V. EO-FLR Securit. 14(22/Und.)	XS1139494493	EUR	0	200
1,3750 % Novo Nordisk Finance [NL] B.V. EO-Med.-T. Notes 22(22/30)	XS2441247041	EUR	0	326
0,0000 % NRW.BANK MTN-IHS Ausg. 0AL v.21(31)	DE000NWB0AL1	EUR	0	400
0,2500 % NRW.BANK MTN-IHS Ausg. 0AQ v.22(32)	DE000NWB0AQ0	EUR	0	593
0,3990 % NTT Finance Corp. EO-Medium-Term Nts 21(21/28)	XS2411311652	EUR	0	315
3,7500 % Orsted A/S EO-Medium-Term Nts 23(23/30)	XS2591029876	EUR	335	335
3,5000 % Schneider Electric SE EO-Med.-Term Notes 22(22/32)	FR001400DTA3	EUR	100	100
2,2500 % SNCF Réseau S.A. EO-Medium-Term-Notes 17(47)	XS1648462023	EUR	100	400
1,0000 % Société du Grand Paris EO-Medium-Term Notes 20(70)	FR0013483914	EUR	0	1.000
3,0000 % Telefónica Europe B.V. EO-FLR Bonds 18(23/Und.)	XS1795406575	EUR	0	1.500
1,8750 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 16(16/36)	XS1432384409	EUR	0	400
1,3750 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 18(18/28)	XS1828037587	EUR	0	400
1,5000 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 19(19/39)	XS2002491863	EUR	0	360
4,5000 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 22(22/34)	XS2549543499	EUR	200	200
2,7500 % TenneT Holding B.V. EO-Med.-Term Notes 22(22/42)	XS2478299469	EUR	0	391
1,8750 % Transurban Finance Co. Pty Ltd EO-Med.-Term Nts 14(24/24)	XS1109744778	EUR	0	250
1,4500 % Transurban Finance Co. Pty Ltd EO-Med.-Term Nts 19(19/29)	XS1997077364	EUR	0	400
0,8000 % UniCredit S.p.A. EO-FLR Preferred MTN 21(28/29)	XS2360310044	EUR	300	300
0,5000 % Vattenfall AB EO-Medium-Term Notes 19(19/26)	XS2009891479	EUR	0	480
0,1250 % Vattenfall AB EO-Medium-Term Notes 21(21/29)	XS2297882644	EUR	0	900
4,1250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 22(25)	XS2554487905	EUR	400	400
3,1250 % Volkswagen Intl Finance N.V. EO-Medium-Term Notes 22(25)	XS2491738352	EUR	0	300
1,0000 % Vonovia Finance B.V. EO-Medium-Term Nts 21(21/41)	DE000A287179	EUR	0	400
2,3750 % Vonovia SE Medium Term Notes v.22(22/32)	DE000A3MQS72	EUR	0	200

AN ORGANISIERTEN MÄRKTEN ZUGELASSENE ODER IN DIESE EINBEZOGENE WERTPAPIERE

Verzinsliche Wertpapiere

2,6000 % Allianz SE FLR-Sub.Ter.Nts.v.21(31/unb.)	DE000A3E5TRO	EUR	400	400
4,6250 % Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR Cap.Secs 18(25/Und.)	XS1877860533	EUR	200	600
3,3750 % Crown European Holdings S.A. EO-Notes 15(15/25) Reg.S	XS1227287221	EUR	0	800
0,6250 % Deutsche Bahn Finance GmbH Medium-Term Notes 20(50)	XS2270142966	EUR	0	300
3,8750 % Deutsche Bahn Finance GmbH Medium-Term Notes 22(42)	XS2541394750	EUR	157	157
2,6250 % Iberdrola International B.V. EO-FLR Securit. 18(23/Und.)	XS1797138960	EUR	0	800
1,6250 % ProLogis Intl Funding II S.A. EO-Med.-Term Nts 20(20/32)	XS2187529180	EUR	0	175
4,6250 % Redeia Corporacion S.A. EO-FLR Notes 23(28/Und.)	XS2552369469	EUR	200	200

FORTSETZUNG: Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stücke bzw. Anteile bzw. Währung in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE (Fortsetzung)				
NICHTNOTIERTE WERTPAPIERE ⁴⁾				
Verzinsliche Wertpapiere				
5,1250 % AXA S.A. EO-FLR Med.-T. Nts 13(23/43)	XS0878743623	EUR	0	230
5,0000 % Hannover Finance (Lux.) S.A. EO-FLR Notes 12(23/43)	XS0856556807	EUR	0	200
6,2500 % Orsted A/S EO-FLR Secs 13(23/13)	XS0943370543	EUR	440	500
DERIVATE (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)				
TERMINKONTRAKTE				
Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte:				
(Basiswert[e]: EURO-BOBL, EURO-BUND)			EUR	12.587,12
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswert[e]: EURO-BOBL, EURO-BUND, EURO-BUXL, EURO-SCHATZ)			EUR	44.769,11

Der Anteil der Transaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 38,63%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 88.958.985,17 EUR.

⁴⁾ Bei den nichtnotierten Wertpapieren können technisch bedingt auch endfällige Wertpapiere ausgewiesen werden.

ODDO BHF Green Bond CN-EUR

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)		insgesamt	je Anteil
für den Zeitraum vom 1.10.2022 bis zum 30.9.2023			
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)	EUR	0,00	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	EUR	0,00	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	EUR	1.042,33	0,14
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR	5.790,13	0,80
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	248,32	0,03
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	EUR	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapierdarlehens- und Pensionsgeschäften	EUR	0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer	EUR	0,00	0,00
10. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR	-0,13	0,00
11. Sonstige Erträge	EUR	1,44	0,00
Summe der Erträge	EUR	7.082,09	0,97
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR	0,00	0,00
2. Verwaltungsvergütung	EUR	-2.103,06	-0,29
– Verwaltungsvergütung	EUR	-2.103,06	
– Beratungsvergütung	EUR	0,00	
– Asset-Management-Gebühr	EUR	0,00	
3. Verwahrstellenvergütung	EUR	-39,02	-0,01
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR	-141,80	-0,02
5. Sonstige Aufwendungen	EUR	-2.156,23	-0,30
– Depotgebühren	EUR	-39,24	
– Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-842,42	
– Sonstige Kosten	EUR	-1.274,57	
– davon Spesen	EUR	-1.274,57	
Summe der Aufwendungen	EUR	-4.440,12	-0,62
III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	2.641,97	0,35
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne	EUR	3.459,04	0,48
2. Realisierte Verluste	EUR	-42.051,15	-5,82
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	-38.592,11	-5,34
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres			
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	9.127,89	1,26
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	15.757,30	2,18
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	24.885,19	3,44
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-11.064,95	-1,55

ODDO BHF Green Bond CN-EUR

Entwicklung des Sondervermögens 2022/2023

I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR		307.793,04
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR		0,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR		266.660,73
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	339.911,93	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-73.251,20	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR		7.544,17
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR		-11.064,95
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	9.127,89	
davon nicht realisierte Verluste	EUR	15.757,30	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR		570.933,00

Verwendung der Erträge des Sondervermögens Berechnung der Wiederanlage insgesamt und je Anteil⁵⁾

I. Für die Wiederanlage verfügbar			
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-35.950,14	-4,99
2. Zuführung aus dem Sondervermögen ⁶⁾	EUR	35.950,14	4,99
3. Steuerabschlag für das Geschäftsjahr	EUR	0,00	0,00
II. Wiederanlage	EUR	0,00	0,00

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	umlaufende Anteile am Geschäftsjahresende Stück	Fondsvermögen am Geschäftsjahresende EUR	Anteilwert am Geschäftsjahresende EUR
2020/2021	3.978	396.110,51	99,58
2021/2022	3.879	307.793,04	79,35
2022/2023	7.231	570.933,00	78,96

⁵⁾ Durch Rundungen der je-Anteil-Werte bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

⁶⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen entspricht dem Betrag, um den die Wiederanlage das realisierte Ergebnis des Geschäftsjahres sowie eventuell einbehaltene Steuern übersteigt.

ODDO BHF Green Bond CR-EUR

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)		insgesamt	je Anteil
für den Zeitraum vom 1.10.2022 bis zum 30.9.2023			
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)	EUR	0,00	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	EUR	0,00	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	EUR	156.674,13	0,45
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR	870.490,45	2,52
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	37.322,45	0,11
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	EUR	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapierdarlehens- und Pensionsgeschäften	EUR	0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer	EUR	0,00	0,00
10. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR	-19,35	0,00
11. Sonstige Erträge	EUR	216,12	0,00
Summe der Erträge	EUR	1.064.683,80	3,08
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR	0,00	0,00
2. Verwaltungsvergütung	EUR	-659.907,81	-1,91
- Verwaltungsvergütung	EUR	-659.907,81	
- Beratungsvergütung	EUR	0,00	
- Asset-Management-Gebühr	EUR	0,00	
3. Verwahrstellenvergütung	EUR	-7.292,35	-0,02
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR	-27.971,13	-0,08
5. Sonstige Aufwendungen	EUR	-40.612,28	-0,12
- Depotgebühren	EUR	-7.335,66	
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	8.949,27	
- Sonstige Kosten	EUR	-42.225,89	
- davon Spesen	EUR	-42.225,89	
Summe der Aufwendungen	EUR	-735.783,57	-2,13
III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	328.900,23	0,95
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne	EUR	519.879,80	1,50
2. Realisierte Verluste	EUR	-6.320.872,45	-18,30
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	-5.800.992,65	-16,80
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres			
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	-5.472.092,42	-15,85
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	-7.833,95	-0,02
	EUR	5.051.398,50	14,62
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	5.043.564,55	14,60
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-428.527,87	-1,25

ODDO BHF Green Bond CR-EUR

Entwicklung des Sondervermögens 2022/2023

I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR		88.556.742,25
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR		0,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR		-2.275.307,59
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	4.263.716,09	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	-6.539.023,68	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR		-75.493,50
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR		-428.527,87
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	-7.833,95	
davon nicht realisierte Verluste	EUR	5.051.398,50	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR		85.777.413,29

Verwendung der Erträge des Sondervermögens Berechnung der Wiederanlage insgesamt und je Anteil ⁷⁾

I. Für die Wiederanlage verfügbar			
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-5.472.092,42	-15,85
2. Zuführung aus dem Sondervermögen ⁸⁾	EUR	5.472.092,42	15,85
3. Steuerabschlag für das Geschäftsjahre	EUR	0,00	0,00
II. Wiederanlage	EUR	0,00	0,00

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	umlaufende Anteile am Geschäftsjahresende Stück	Fondsvermögen am Geschäftsjahresende EUR	Anteilwert am Geschäftsjahresende EUR
2019/2020	386.578,79	123.290.207,87	318,93
2020/2021	379.588	119.157.081,56	313,91
2021/2022	354.551	88.556.742,25	249,77
2022/2023	345.487	85.777.413,29	248,28

⁷⁾ Durch Rundungen der je-Anteil-Werte bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

⁸⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen entspricht dem Betrag, um den die Wiederanlage das realisierte Ergebnis des Geschäftsjahres sowie eventuell einbehaltene Steuern übersteigt.

ODDO BHF Green Bond DI-EUR

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)		insgesamt	je Anteil
für den Zeitraum vom 1.10.2022 bis zum 22.11.2022			
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)	EUR	0,00	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	EUR	0,00	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	EUR	2,83	0,19
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR	19,08	1,27
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	0,12	0,01
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	EUR	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapierdarlehens- und Pensionsgeschäften	EUR	0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer	EUR	0,00	0,00
10. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR	0,00	0,00
11. Sonstige Erträge	EUR	0,00	0,00
Summe der Erträge	EUR	22,03	1,47
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR	0,00	0,00
2. Verwaltungsvergütung	EUR	-3,16	-0,21
– Verwaltungsvergütung	EUR	-3,16	
– Beratungsvergütung	EUR	0,00	
– Asset-Management-Gebühr	EUR	0,00	
3. Verwahrstellenvergütung	EUR	-0,13	-0,01
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR	-0,31	-0,02
5. Sonstige Aufwendungen	EUR	-0,79	-0,05
– Depotgebühren	EUR	-0,08	
– Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	0,00	
– Sonstige Kosten	EUR	-0,71	
– davon Spesen	EUR	-0,71	
Summe der Aufwendungen	EUR	-4,40	-0,29
III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	17,63	1,18
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne	EUR	0,66	0,04
2. Realisierte Verluste	EUR	-106,34	-7,09
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	-105,68	-7,05
V. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres			
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	16,42	1,09
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	348,89	23,26
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	365,31	24,35
VII. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	277,26	18,48

ODDO BHF Green Bond DI-EUR

Entwicklung des Sondervermögens 2022

I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Rumpfgeschäftsjahres	EUR		10.983,25
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR		0,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR		0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR		0,00
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	0,00	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	0,00	
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR		0,00
5. Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR		277,26
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	16,42	
davon nicht realisierte Verluste	EUR	348,89	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Rumpfgeschäftsjahres	EUR		11.260,51

Verwendung der Erträge des Sondervermögens Berechnung der Ausschüttung insgesamt und je Anteil ⁹⁾

I. Für die Ausschüttung verfügbar	EUR	18,30	1,22
1. Vortrag aus Vorjahr	EUR	0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Rumpfgeschäftsjahres	EUR	-88,05	-5,87
3. Zuführung aus dem Sondervermögen ¹⁰⁾	EUR	106,34	7,09
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	EUR	18,30	1,22
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	0,00	0,00
2. Ausgekehrte Erträge im Rahmen der Anteilscheinrückgabe	EUR	18,30	1,22
III. Gesamtausschüttung	EUR	0,00	0,00
1. Endausschüttung	EUR	0,00	0,00

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	umlaufende Anteile am Geschäftsjahresende Stück	Fondsvermögen am Geschäftsjahresende EUR	Anteilwert am Geschäftsjahresende EUR
2020/2021	15	14.650,04	976,67
2021/2022	15	10.983,25	732,22
Auflösung 22.11.2022	15	11.260,51	750,70

⁹⁾ Durch Rundungen der je-Anteil-Werte bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

¹⁰⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen entspricht dem Betrag, um den die Gesamtausschüttung das realisierte Ergebnis des Geschäftsjahres und den Vortrag aus dem Vorjahr übersteigt.

ODDO BHF Green Bond DP-EUR

Ertrags- und Aufwandsrechnung (inkl. Ertragsausgleich)		insgesamt	je Anteil
für den Zeitraum vom 1.10.2022 bis zum 30.9.2023			
I. Erträge			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaft-/Kapitalertragsteuer)	EUR	0,00	0,00
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)	EUR	0,00	0,00
3. Zinsen aus inländischen Wertpapieren	EUR	15.990,35	1,45
4. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer)	EUR	88.906,46	8,09
5. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	EUR	3.810,61	0,35
6. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)	EUR	0,00	0,00
7. Erträge aus Investmentanteilen	EUR	0,00	0,00
8. Erträge aus Wertpapierdarlehens- und Pensionsgeschäften	EUR	0,00	0,00
9. Abzug inländischer Körperschaft-/Kapitalertragsteuer	EUR	0,00	0,00
10. Abzug ausländischer Quellensteuer	EUR	-1,98	0,00
11. Sonstige Erträge	EUR	22,06	0,00
Summe der Erträge	EUR	108.727,50	9,89
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen	EUR	0,00	0,00
2. Verwaltungsvergütung	EUR	-8.288,38	-0,75
- Verwaltungsvergütung	EUR	-8.288,38	
- Beratungsvergütung	EUR	0,00	
- Asset-Management-Gebühr	EUR	0,00	
3. Verwahrstellenvergütung	EUR	-468,29	-0,04
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	EUR	-1.445,46	-0,13
5. Sonstige Aufwendungen	EUR	-13.972,54	-1,27
- Depotgebühren	EUR	-480,31	
- Ausgleich ordentlicher Aufwand	EUR	-9.337,77	
- Sonstige Kosten	EUR	-4.154,46	
- davon Spesen	EUR	-4.154,46	
Summe der Aufwendungen	EUR	-24.174,68	-2,20
III. Ordentlicher Nettoertrag	EUR	84.552,82	7,69
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne	EUR	53.163,07	4,84
2. Realisierte Verluste	EUR	-645.201,65	-58,71
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	EUR	-592.038,58	-53,87
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres			
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	EUR	-507.485,76	-46,18
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	EUR	69.005,34	6,28
	EUR	134.747,45	12,26
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	203.752,79	18,54
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-303.732,97	-27,64

ODDO BHF Green Bond DP-EUR

Entwicklung des Sondervermögens 2022/2023

I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	EUR	3.196.543,26
1. Ausschüttung für das Vorjahr/Steuerabschlag für das Vorjahr	EUR	0,00
2. Zwischenausschüttungen	EUR	0,00
3. Mittelzufluss/-abfluss (netto)	EUR	5.650.157,01
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	EUR	5.650.157,01
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	EUR	0,00
4. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	EUR	240.912,12
5. Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-303.732,97
davon nicht realisierte Gewinne	EUR	69.005,34
davon nicht realisierte Verluste	EUR	134.747,45
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	EUR	8.783.879,41

Verwendung der Erträge des Sondervermögens Berechnung der Ausschüttung insgesamt und je Anteil ¹¹⁾

I. Für die Ausschüttung verfügbar	EUR	84.513,10	7,69
1. Vortrag aus Vorjahr	EUR	0,00	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	EUR	-507.485,76	-46,18
3. Zuführung aus dem Sondervermögen ¹²⁾	EUR	591.998,86	53,87
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet	EUR	0,00	0,00
1. Der Wiederanlage zugeführt	EUR	0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung	EUR	0,00	0,00
III. Gesamtausschüttung	EUR	84.513,10	7,69
1. Endausschüttung	EUR	84.513,10	7,69

Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre

Geschäftsjahr	umlaufende Anteile am Geschäftsjahresende Stück	Fondsvermögen am Geschäftsjahresende EUR	Anteilwert am Geschäftsjahresende EUR
2020/2021	4.000	4.012.087,67	1.003,02
2021/2022	4.000	3.196.543,26	799,14
2022/2023	10.990	8.783.879,41	799,26

¹¹⁾ Durch Rundungen der je-Anteil-Werte bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

¹²⁾ Die Zuführung aus dem Sondervermögen entspricht dem Betrag, um den die Gesamtausschüttung das realisierte Ergebnis des Geschäftsjahres und den Vortrag aus dem Vorjahr übersteigt.

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

**Angaben nach der Derivateverordnung
das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure** **EUR 1.646.100,78**

die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte

ODDO BHF (Broker) DE

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) **98,63**
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) **-0,01**

Der qualifizierte Ansatz gemäß DerivateV sieht die Messung des Marktrisikos des Sondervermögens und eines derivatfreien Vergleichsvermögens mit Hilfe eines anerkannten Value-at-Risk-Modells (VaR) vor. Dabei darf der Anrechnungsbetrag für das Marktrisiko des Sondervermögens zu keinem Zeitpunkt das Zweifache des potentiellen Risikobetrags für das Marktrisiko des zugehörigen Vergleichsvermögens übersteigen. Zudem sind die für das Sondervermögen im Geschäftsjahr ermittelten potenziellen Risikobeträge für das Marktpreisrisiko im Jahresbericht zu veröffentlichen. Dabei sind mindestens der kleinste, der größte und der durchschnittliche potenzielle Risikobetrag anzugeben. Die für das Sondervermögen im Geschäftsjahr ermittelten potenziellen Risikobeträge für das Marktpreisrisiko ergeben sich wie folgt:

Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gem. § 37 Abs. 4 DerivateV

kleinster potenzieller Risikobetrag	2,83%
größter potenzieller Risikobetrag	4,13%
durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	3,54%

Im Geschäftsjahr erreichte durchschnittliche Hebelwirkung durch Derivategeschäfte: 1,03

Das KAGB eröffnet Kapitalverwaltungsgesellschaften für ihre Sondervermögen erweiterte Möglichkeiten der Gestaltung von Anlage- und Risikoprofilen. Hierbei können Derivate zur Steigerung der Rendite, Verminderung des Risikos usw. eine bedeutende Rolle spielen. Sofern Derivate eingesetzt werden sollen, gelten u.a. Begrenzungen des Markt- und Kontrahentenrisikos.

Zusammensetzung des Vergleichsvermögens zum Berichtsstichtag

MSCI Green Bonds Index	100%
------------------------	------

Zur Risikomessung wird eine Moderne Historische Simulation (gegebenenfalls ergänzt um Monte Carlo-Simulation bei nicht linearen Risiken) verwendet, welches die Marktpreisrisiken auf einem einseitigen Prognoseintervall mit einem Wahrscheinlichkeitsniveau in Höhe von 99 Prozent und einer Haltedauer von 10 Tagen bei einer dynamisch gewichteten, historischen Zeitreihe von 3 Jahren ermittelt. Diese Werte sind vergangenheitsorientiert und beziehen sich auf den Zeitraum vom 1.10.2022 bis 30.9.2023

Sonstige Angaben

ODDO BHF Green Bond CN-EUR

Anteilwert	EUR	78,96
Ausgabepreis	EUR	81,33
Rücknahmepreis	EUR	78,96
Anteile im Umlauf	Stück	7.231

ODDO BHF Green Bond CR-EUR

Anteilwert	EUR	248,28
Ausgabepreis	EUR	255,73
Rücknahmepreis	EUR	248,28
Anteile im Umlauf	Stück	345.487

ODDO BHF Green Bond DP-EUR

Anteilwert	EUR	799,26
Ausgabepreis	EUR	799,26
Rücknahmepreis	EUR	799,26
Anteile im Umlauf	Stück	10.990

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Bewertung

Gemäß den Vorschriften der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung (KARBV) aktualisiert ODDO BHF Asset Management GmbH (ODDO BHF AM GmbH) als Kapitalverwaltungsgesellschaft (KVG) die im Hause verwendeten Bewertungspreise aller gehaltenen Instrumente durch geeignete Prozesse auf täglicher Basis.

Die Pflege der Bewertungspreise erfolgt handelsunabhängig.

Um der Vielfältigkeit der unterschiedlichen Instrumente Rechnung zu tragen, werden die genutzten Verfahren in einem Pricing Committee in regelmäßigen Abständen vorgestellt, überprüft und ggf. adjustiert. Das Pricing Committee hat die folgenden Aufgaben und Ziele:

Aufgaben

- Festlegung der Bewertungsprozesse sowie der Kursquellen der einzelnen Assetklassen
- Regelmäßige Überprüfung der festgelegten Bewertungs-/ Überwachungsprozesse (z.B. bei fehlenden Preisen (Missing Prices), wesentlichen Kursprüngen (Price Movements), über längere Zeit unveränderten Kursen (Stale Prices)) sowie der präferierten Kursquellen
- Entscheidung über das Vorgehen bei vom Standardprozess abweichenden Bewertungen
- Entscheidung über Bewertungsverfahren bei Sonderfällen (z.B. illiquide Wertpapiere)

Ziele

- Kommunikation der bestehenden Prozesse zur Ermittlung der Bewertungspreise an die beteiligten Bereiche
- Fortlaufende Optimierung der Prozesse zur Ermittlung der Bewertungspreise

Bei Einrichtung wird jedes Instrument gemäß seinen Ausstattungsmerkmalen einem Prozess für die Kursversorgung zugeordnet. Dieser beinhaltet die Festlegung des Datenlieferanten, des Aktualisierungsintervalls, die Auswahl der Preisquellen sowie das generelle Vorgehen.

Neben automatisierten Schnittstellenbelieferungen über Bloomberg und Reuters werden auch andere geeignete Kurs- und Bewertungsquellen zur Bewertung von Instrumenten herangezogen. Dies erfolgt in Fällen, bei denen über die Standardkursquellen keine adäquaten Bewertungen verfügbar sind. Zusätzlich kann auf Bewertungen von Arrangeuren (z.B. bei Asset Backed Securities) zurückgegriffen werden. Um fortlaufend eine hochwertige Kursversorgung zu gewährleisten, wurden standardisierte Prüfroutinen zur Qualitätssicherung implementiert.

Die Bewertungen der einzelnen Vermögensgegenstände stellen sich wie folgt dar:

An einer Börse zugelassene/in organisiertem Markt gehandelte Vermögensgegenstände

Vermögensgegenstände, die zum Handel an Börsen zugelassen sind oder in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, sowie Bezugsrechte werden zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet, sofern nachfolgend nicht anders angegeben.

Nicht an Börsen notierte oder organisierten Märkten gehandelte Vermögensgegenstände oder Vermögensgegenstände ohne handelbaren Kurs

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist, sofern nachfolgend nicht anders angegeben. Unter dem Verkehrswert ist der Betrag zu verstehen, zu dem der jeweilige Vermögensgegenstand in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ausgetauscht werden könnte.

Nichtnotierte Schuldverschreibungen und Schuldscheindarlehen

Für die Bewertung von Schuldverschreibungen, die nicht zum Handel an der Börse zugelassen oder in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind (z.B. nicht notierte Anleihen, Commercial Papers und Einlagenzertifikate), und für die Bewertung von Schuldscheindarlehen werden die für vergleichbare Schuldverschreibungen und Schuldscheindarlehen vereinbarten Preise und gegebenenfalls die Kurswerte von Anleihen vergleichbarer Aussteller mit entsprechender Laufzeit und Verzinsung, erforderlichenfalls mit einem Abschlag zum Ausgleich der geringeren Veräußerbarkeit, herangezogen.

Geldmarktinstrumente

Bei Geldmarktinstrumenten kann die KVG die Anteilpreisberechnung unter Hinzurechnung künftiger Zinsen und Zinsbestandteile bis einschließlich des Kalendertages vor dem Valutatag vornehmen. Dabei sind die auf der Ertragsseite zu erfassenden Zinsabgrenzungen je Anlage zu berücksichtigen. Für die Aufwandsseite können alle noch nicht fälligen Leistungen der KVG, wie Verwaltungsvergütungen, Verwahrstellengebühren, Prüfungskosten, Kosten der Veröffentlichung etc., einbezogen werden, die den Anteilpreis beeinflussen.

Bei den im Fonds befindlichen Geldmarktinstrumenten können Zinsen und zinsähnliche Erträge sowie Aufwendungen (z.B. Verwaltungsvergütung, Verwahrstellenvergütung, Prüfungskosten, Kosten der Veröffentlichung etc.) bis einschließlich des Tages vor dem Valutatag berücksichtigt werden.

Optionsrechte und Terminkontrakte

Die zu einem Fonds gehörenden Optionsrechte und die Verbindlichkeiten aus einem Dritten eingeräumten Optionsrechten, die zum Handel an einer Börse zugelassen oder in einen anderen organisierten Markt einbezogen sind, werden zu dem jeweils letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet.

Das gleiche gilt für Forderungen und Verbindlichkeiten aus für Rechnung des Fonds verkauften Terminkontrakten. Die zu Lasten des Fonds geleisteten Einschüsse werden unter Einbeziehung der am Börsentag festgestellten Bewertungsgewinne und Bewertungsverluste zum Wert des Fonds hinzuge-rechnet.

Bankguthaben, Festgelder, Investmentanteile und Darlehen

Bankguthaben werden grundsätzlich zu ihrem Nennwert zuzüglich zugeflossener Zinsen bewertet.

Festgelder werden zum Verkehrswert bewertet, sofern das Festgeld jederzeit kündbar ist und die Rückzahlung bei der Kündigung nicht zum Nennwert zuzüglich Zinsen erfolgt.

Investmentanteile werden grundsätzlich mit ihrem letzten festgestellten Rücknahmepreis angesetzt oder zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet. Stehen diese Werte nicht zur Verfügung, werden Investmentanteile zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

Für die Rückerstattungsansprüche aus Darlehensgeschäften ist der jeweilige Kurswert der als Darlehen übertragenen Vermögensgegenstände maßgebend.

Auf ausländische Währung lautende Vermögensgegenstände

Auf ausländische Währung lautende Vermögensgegenstände werden zum 17:00 Uhr-Fixing des Bewertungstages der World Market Rates (Quelle: Datastream) umgerechnet.

Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote

ODDO BHF Green Bond CN-EUR

Gesamtkostenquote

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für den abgelaufenen Berichtszeitraum beträgt 0,77%

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Berichtszeitraum getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen	EUR	0,00
---	-----	------

Hinweis gem. § 101 Abs. 2 Nr. 3 KAGB (Kostentransparenz)

Die Gesellschaft erhält aus dem Sondervermögen die ihr zustehende Verwaltungsvergütung. Ein wesentlicher Teil der Verwaltungsvergütung wird für Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens verwendet. Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen von den an die Verwahrstelle und an Dritte aus dem Sondervermögen geleisteten Vergütungen und Aufwendungserstattungen zu. Sie hat im Zusammenhang mit Handelsgeschäften für das Sondervermögen keine geldwerten Vorteile von Handelspartnern erhalten.

ODDO BHF Green Bond CR-EUR

Gesamtkostenquote

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für den abgelaufenen Berichtszeitraum beträgt 0,84%

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Berichtszeitraum getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen	EUR	0,00
---	-----	------

Hinweis gem. § 101 Abs. 2 Nr. 3 KAGB (Kostentransparenz)

Die Gesellschaft erhält aus dem Sondervermögen die ihr zustehende Verwaltungsvergütung. Ein wesentlicher Teil der Verwaltungsvergütung wird für Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens verwendet. Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen von den an die Verwahrstelle und an Dritte aus dem Sondervermögen geleisteten Vergütungen und Aufwendungserstattungen zu. Sie hat im Zusammenhang mit Handelsgeschäften für das Sondervermögen keine geldwerten Vorteile von Handelspartnern erhalten.

ODDO BHF Green Bond DI-EUR

Gesamtkostenquote

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für den abgelaufenen Berichtszeitraum beträgt 0,28%

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Berichtszeitraum getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen	EUR	0,00
---	-----	------

Hinweis gem. § 101 Abs. 2 Nr. 3 KAGB (Kostentransparenz)

Die Gesellschaft erhält aus dem Sondervermögen die ihr zustehende Verwaltungsvergütung. Ein wesentlicher Teil der Verwaltungsvergütung wird für Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens verwendet. Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen von den an die Verwahrstelle und an Dritte aus dem Sondervermögen geleisteten Vergütungen und Aufwendungserstattungen zu. Sie hat im Zusammenhang mit Handelsgeschäften für das Sondervermögen keine geldwerten Vorteile von Handelspartnern erhalten.

ODDO BHF Green Bond DP-EUR

Gesamtkostenquote

Die Gesamtkostenquote (ohne Transaktionskosten) für den abgelaufenen Berichtszeitraum beträgt 0,27%

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Sondervermögen im Berichtszeitraum getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Sondervermögens aus.

An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen	EUR	0,00
---	-----	------

Hinweis gem. § 101 Abs. 2 Nr. 3 KAGB (Kostentransparenz)

Die Gesellschaft erhält aus dem Sondervermögen die ihr zustehende Verwaltungsvergütung. Ein wesentlicher Teil der Verwaltungsvergütung wird für Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens verwendet. Der Gesellschaft fließen keine Rückvergütungen von den an die Verwahrstelle und an Dritte aus dem Sondervermögen geleisteten Vergütungen und Aufwendungserstattungen zu. Sie hat im Zusammenhang mit Handelsgeschäften für das Sondervermögen keine geldwerten Vorteile von Handelspartnern erhalten.

Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen

ODDO BHF Green Bond CN-EUR

Sonstige Erträge:

Keine wesentlichen sonstigen Erträge.

Sonstige Aufwendungen:

Die wesentlichen sonstigen Aufwendungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung ausgewiesen.

ODDO BHF Green Bond CR-EUR

Sonstige Erträge:

Keine wesentlichen sonstigen Erträge.

Sonstige Aufwendungen:

Die wesentlichen sonstigen Aufwendungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung ausgewiesen.

ODDO BHF Green Bond DI-EUR

Sonstige Erträge:

Keine wesentlichen sonstigen Erträge.

Sonstige Aufwendungen:

Die wesentlichen sonstigen Aufwendungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung ausgewiesen.

ODDO BHF Green Bond DP-EUR

Sonstige Erträge:

Keine wesentlichen sonstigen Erträge.

Sonstige Aufwendungen:

Die wesentlichen sonstigen Aufwendungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung ausgewiesen.

Transaktionskosten (Summe der Nebenkosten des Erwerbs [Anschaffungsnebenkosten] und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände)

Transaktionskosten	EUR	2.105,38
--------------------	-----	----------

Die Transaktionskosten berücksichtigen sämtliche Kosten, die im Geschäftsjahr für Rechnung des Fonds separat ausgewiesen bzw. abgerechnet wurden und in direktem Zusammenhang mit einem Kauf oder Verkauf von Vermögensgegenständen stehen.

Angaben zur Mitarbeitervergütung

Gesamtsumme der im Zeitraum vom 1.1.2022 bis zum 31.12.2022 gezahlten Mitarbeitervergütung:	TEUR	24.731
Feste Vergütung inklusive zusätzliche Sachkosten:	TEUR	20.018
Variable Vergütung:	TEUR	4.865
Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen:	TEUR	-
Zahl der MA der KVG im Durchschnitt:		179
Höhe des gezahlten Carried Interest:	TEUR	-
Gesamtsumme der im Zeitraum vom 1.1.2022 bis zum 31.12.2022 gezahlten an bestimmte Mitarbeitergruppen:	TEUR	12.391
davon Geschäftsleiter:	TEUR	792
davon andere Führungskräfte:	TEUR	-
davon andere Risikoträger:	TEUR	2.924
davon Mitarbeiter mit Kontrollfunktion:	TEUR	312
davon Mitarbeiter mit gleicher Einkommensstufe:	TEUR	8.363

Als Grundlage für die Berechnung der Gesamtsumme der im abgelaufenen Wirtschaftsjahr der KVG gezahlten MA-Vergütung diente der Jahresabschluss der KVG. Berücksichtigt wurden auch zusätzliche Sachzuwendungen (z. B. PKW- und Jobrad-Kosten, Miete Garage) gemäß Kontenplan.

Beschreibung, wie die Vergütungen und gegebenenfalls sonstige Zuwendungen berechnet wurden:

- Die Vergütung eines Mitarbeiters der Gesellschaft orientiert sich an seiner Funktion, deren Komplexität und den damit verbundenen Aufgaben sowie der für diese Funktion am Markt üblichen Vergütung. Im Verhältnis zur variablen Vergütung wird die fixe Vergütung für jeden Mitarbeiter so bemessen, dass in Bezug auf die Zahlung einer variablen Vergütung zu jeder Zeit vollständige Flexibilität herrscht, einschließlich der Möglichkeit des vollständigen Verzichts auf die Zahlung einer variablen Vergütung. Variable Vergütung wird u. a. in Abhängigkeit von der Art der einzelnen Geschäftsbereiche konzipiert. Kein in einer Kontrollfunktion (z. B. in den Bereichen Investment Controlling oder Compliance) tätiger Mitarbeiter erhält eine Vergütung, die an die Ergebnisse der von ihm betreuten oder kontrollierten Geschäftsbereiche gekoppelt ist.
- In den Kreis der Identifizierten Mitarbeiter wurden neben der Geschäftsführung alle Bereichsleiter innerhalb des Geschäftsbereichs Investment Management, die direkt an den CEO der Gesellschaft berichten sowie Mitarbeiter der zweiten Berichtsebene unterhalb des CEO, die Entscheidungsbefugnisse bezüglich Musterportfolien oder Asset Allocation haben, aufgenommen. Der Leiter Investment Controlling und der Compliance Officer der Gesellschaft wurden als zentrale Mitarbeiter definiert, die für unabhängige Kontrollfunktionen verantwortlich sind, welche unmittelbaren Einfluss auf das Sondervermögen haben. Mitarbeiter mit vergleichbarer Gesamtvergütung werden jährlich ermittelt und entsprechend berücksichtigt.
- Die Gewährung von variabler Vergütung erfolgt im Rahmen der Vergütungsrichtlinie für den Standort Düsseldorf vollständig diskretionär durch die Gesellschaft. Sie enthält nach Maßgabe der Vergütungsrichtlinie ein oder mehrere der nachfolgenden Bausteine: langfristige Anreize in Form zurückgestellter Zahlungen ggf. mit Performancekomponente, Mitarbeiterbeteiligungen oder Barkomponenten.
- Für den Standort Frankfurt existiert eine Betriebsvereinbarung zur variablen Vergütung, die zur Anwendung kommt. Diese stellt ebenfalls sicher, dass schädliche Anreize mit Auswirkungen auf die Gesellschaft bzw. die Investmentvermögen vermieden werden.

Ergebnisse der jährlichen Überprüfung der Vergütungspolitik:

Keine Anpassung der Vergütungsrichtlinie erforderlich.

Angaben zu wesentlichen Änderungen der festgelegten Vergütungspolitik:

Es hat keine Änderungen zur Vergütungspolitik gegeben.

Anteilklassenmerkmale im Überblick	Mindest- anlagesumme	Aufgabeaufschlag bis zu 3,00%, derzeit	Verwaltungsvergütung bis zu 1,000% p.a., derzeit	Ertragsverwendung	Währung
Anteilklasse	EUR				
ODDO BHF Green Bond CN-EUR	100	3,00	0,450	Thesaurierer	EUR
ODDO BHF Green Bond CR-EUR	100	3,00	0,750	Thesaurierer	EUR
ODDO BHF Green Bond DP-EUR	2.000.000	0,00	0,150	Ausschüttung mit Zwischenaussschüttung	EUR

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: ODDO BHF Green Bond

Unternehmenskennung (LEI-Code):
529900W4IPS4XZPNQZ56

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 99,6%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0%

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es N/A an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das nachhaltige Ziel des Fonds ist es, einen positiven Beitrag zum Klima- und Umweltschutz zu leisten. ODDO BHF Green Bond investiert daher bis zu 100 % seines Vermögens in grüne Anleihen internationaler Emittenten. Green Bonds sind verzinsliche Anleihen, deren Emissionserlöse zur Finanzierung oder Refinanzierung neuer oder bestehender Umwelt- oder Klimaschutzprojekte verwendet werden. Diese unterstützen den Übergang zu einer kohlenstoffneutralen Wirtschaft. Der Fonds kann auch bis zu 25% seines Vermögens in Nachhaltigkeitsanleihen investieren. Nachhaltigkeitsanleihen sind zinstragende Anleihen, deren Emissionserlöse zur Finanzierung oder Refinanzierung einer Kombination aus grünen und sozialen Projekten verwendet werden. Wir bevorzugen Nachhaltigkeitsanleihen, die sich auf die Finanzierung grüner Projekte konzentrieren.

Die zugrunde liegenden Anlagen, mit Ausnahme von Barmitteln und Derivaten, wurden als nachhaltige Anlagen betrachtet, die zu dem in den vorvertraglichen Informationen des Fonds beschriebenen Umweltziel beitragen, da sie 99,7% des Fonds in Green Bonds investiert hatten. Darüber hinaus wurden 0,3% des Fonds in Nachhaltigkeitsanleihen investiert.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das nachhaltige Ziel des Fonds ist es, einen positiven Beitrag zum Klima- und Umweltschutz zu leisten. ODDO BHF Green Bond investiert daher bis zu 100 % seines Vermögens in grüne Anleihen internationaler Emittenten. Hierbei kommen Ausschlusskriterien zur Anwendung. Green Bonds sind verzinsliche Anleihen, deren Emissionserlöse zur Finanzierung oder Refinanzierung neuer oder bestehender Umwelt- oder Klimaschutzprojekte verwendet werden. Diese unterstützen den Übergang zu einer kohlenstoffneutralen Wirtschaft. Der Fonds kann auch bis zu 25% seines Vermögens in Nachhaltigkeitsanleihen investieren. Nachhaltigkeitsanleihen sind zinstragende Anleihen, deren Emissionserlöse zur Finanzierung oder Refinanzierung einer Kombination aus grünen und sozialen Projekten verwendet werden. Wir bevorzugen Nachhaltigkeitsanleihen, die sich auf die Finanzierung grüner Projekte konzentrieren.

Die zugrunde liegenden Anlagen, mit Ausnahme von Barmitteln und Derivaten, wurden als nachhaltige Anlagen betrachtet, die zu dem in den vorvertraglichen Informationen des Fonds beschriebenen Umweltziel beitragen, da sie 99,7% des Fonds in Green Bonds investiert hatten. Darüber hinaus wurden 0,3% des Fonds in Nachhaltigkeitsanleihen investiert.

	Fonds	Anteil analysierter Titel (%)
ESG-Ranking (/5)*	4,2	91,4
Gewichtetes durchschnittliches E Ranking (/5)*	4,1	91,4
Gewichtetes durchschnittliches S Ranking (/5)*	2,9	91,4
Gewichtetes durchschnittliches G Ranking (/5)*	3,9	91,4
Gewichtete durchschnittl. CO ₂ -Intensität (tCO ₂ / Mio. € Umsatz)	148,1	100,0
Nachhaltige Anlagen (%)	99,6	100,0
Taxonomie-ausgerichtete Investitionen (%)	NA	NA
Nutzung fossiler Brennstoffe (%) **	3,3	3,3
Einsatz von CO ₂ -freien Lösungen („grüner Anteil“) (%) **	28,9	29,0

*1/5 ist risikoreich und 5/5 ist chancenreich

**Summe der Gewichte der Unternehmen im Portfolio, deren Umsatz zum Teil durch den Einsatz fossiler Brennstoffe erzielt wird

***Summe der Gewichte der Unternehmen im Portfolio, deren Umsatz zum Teil durch den Einsatz CO₂-freier Lösungen erzielt wird (erneuerbare Energien, nachhaltige Mobilität, usw.)

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um das erste Berichtsjahr handelt, ist ein Vergleich mit früheren Zeiträumen noch nicht möglich.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?**

Der Manager führte sein „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“-Screening auf der Grundlage der folgenden Kriterien durch:

- Bewertung der Qualität grüner, sozialer und nachhaltiger Anleihen bei gleichzeitiger Evaluierung der "signifikanten Schäden".
- ESG-Integration: Bewertung von Nachhaltigkeitsrisiken im Anlageprozess unter Berücksichtigung der ESG-Merkmale (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung)
- Normatives Screening, einschließlich UN Global Compact und kontroverse Waffen)
- Sektor Ausschlüsse und ein Best-in-Universe-Ansatz.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Einige Indikatoren (PAI7, PAI 10, PAI 14) beruhen auf Listen mit negativen Ausschlusskriterien, die jegliche Investitionen untersagen, während andere PAI (PAI 1, PAI 2, PAI 3, PAI 5, PAI 6 und PAI 9) von den Portfoliomanagern im Rahmen des Due-Diligence-Verfahrens überwacht und während der gesamten Verwaltung des Fonds so weit wie möglich verbessert werden, jedoch ohne besondere Auflagen.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja, die Investitionen wurden auf der Grundlage einer internen Ausschlussliste, die sich auf externe und interne Bewertungen stützt, an den UN Global Compact angepasst. Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte werden jedoch nicht direkt berücksichtigt, sondern indirekt über die MSCI ESG-Rating-Methode.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Fondsmanager wandte die Vorhandelsregeln auf drei PAI an:

1. Exposition gegenüber kontroversen Waffen (PAI 14 und 0% Toleranz),
2. Aktivitäten, die sich negativ auf schützenswerte Gebiete mit hoher biologischer Vielfalt auswirken (PAI 7 und 0% Toleranz)
3. Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) Leitsätze für multinationale Unternehmen (PAI 10 und 0 % Toleranz).

Darüber hinaus bezog sich der Fondsmanager bei seiner ESG-Analyse auf andere PAIs für Unternehmen, zu denen solche Informationen verfügbar waren, für die es aber keine automatischen Ausschlusskriterien gab.

Diese Sammlung von PAI-Daten wurde verwendet, um das endgültige ESG-Rating des Fondsmanagers zu ermitteln.

Die ESG-Analyse umfasste die Überwachung der Treibhausgasemissionen (PAI 1), das Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind (PAI 4), den Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Quellen (PAI 5), die Intensität des Energieverbrauchs

in klimaintensiven Sektoren (PAI 6), das Fehlen von Prozessen und Compliance zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Prinzipien und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (PAI 11), das unbereinigte geschlechtsspezifische Lohngefälle (PAI 12) und die geschlechtsspezifische Vielfalt in Leitungsgremien (PAI 13).

Der Fondsmanager verwies auch auf zwei weitere PAI: Entwaldung (zusätzlicher PAI 15) und fehlende Menschenrechtspolitik (zusätzlicher PAI 9).

Für den Fall, dass der Fonds in Staatsanleihen investierte, bezog das ESG-Modell des Fondsmanagers die bei den wichtigsten PAIs in seine ESG-Analyse ein: Intensität der Treibhausgasemissionen (PAI 15) und Länder, in die investiert wird und die gegen Sozialvorschriften verstoßen (PAI 16).

Die Indikatoren für negative Auswirkungen auf die Nachhaltigkeitsfaktoren wurden auch in Bezug auf die entsprechenden Projekte berücksichtigt, die durch die grünen Anleihen und die Nachhaltigkeitsanleihen finanziert wurden, sofern genügend Daten für die Durchführung der Analyse verfügbar und zugänglich waren.

Principal Adverse Impact [PAI]	30.09.2023	Anteil analysierter Titel (%)
Scope 1-THG-Emissionen (per Mio EUR)	3454,42	39,25
1. Scope 2-THG-Emissionen (per Mio EUR)	381,74	39,25
Scope 3-THG-Emissionen (per Mio EUR)	31401,84	39,25
2. Gesamt THG-Emissionen (per Mio EUR)	35238,01	39,25
3. CO2-Fußabdruck (per Mio EUR)	606,40	39,25
4. THG-Intensität der Unternehmen, in die investiert wird (per Mio EUR)	910,47	56,8
5. Anteil der Investitionen in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind (%)	12,6	57,9
6. Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen (%)	54,4	41,4
7. Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (%)	5,0	13,5
8. Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken (%)	0,0	57,9
9. Emissionen in Wasser (%)	0,0	0,0
10. Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle (%)	1,3	11,6
11. Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (%)	0,0	57,9
12. Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen (%)	9,1	57,9
13. Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle (%)	14,0	18,8
14. Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen (%)	44,5	50,2
15. Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) (%)	0,0	57,9



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.10.2022 – 30.09.2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte*	Land
France (Govt Of) 1.75% 06/2039	Staatsanleihen	6,17%	Frankreich
KfW 0.00% 09/2028	Staatliche Garantie	3,70%	Deutschland
Netherlands Government 0.50% 01/2040	Staatsanleihen	2,81%	Niederlande
Belgium Kingdom 1.25% 04/2033	Staatsanleihen	1,90%	Belgien
Regie Autonome Transport Parisien 0.35% 06/2029	Versorger	1,78%	Frankreich
Landwirtschaftliche Rentenbank 0,00% 06/2031	Staatliche Garantie	1,73%	Deutschland
Bundesobligation 0.00% 10/2025	Staatsanleihen	1,69%	Deutschland
Government Of Italy 4,00% 04/2035	Staatsanleihen	1,67%	Italien
Credit Agricole Home Loa 0.05% 12/2029	Hypothekenspanien	1,56%	Frankreich
Government Of Germany 0,00% 08/2031	Staatsanleihen	1,55%	Deutschland
European Union 0,4% 02/2037	Supranational	1,47%	Belgien
Societe Du Grand Paris 1.13% 05/2034	Versorger	1,41%	Frankreich
European Investment Bank 1.00% 11/2042	Supranational	1,21%	Supranational
NRW Bank 0.00% 10/2029	Lokale Behörden	1,13%	Deutschland
Bpce Sa E3M 01/2028	Bankwesen	1,08%	Frankreich

* Berechnungsmethode bezogen auf den Durchschnitt von 4 Beständen im Geschäftsjahr des Fonds.

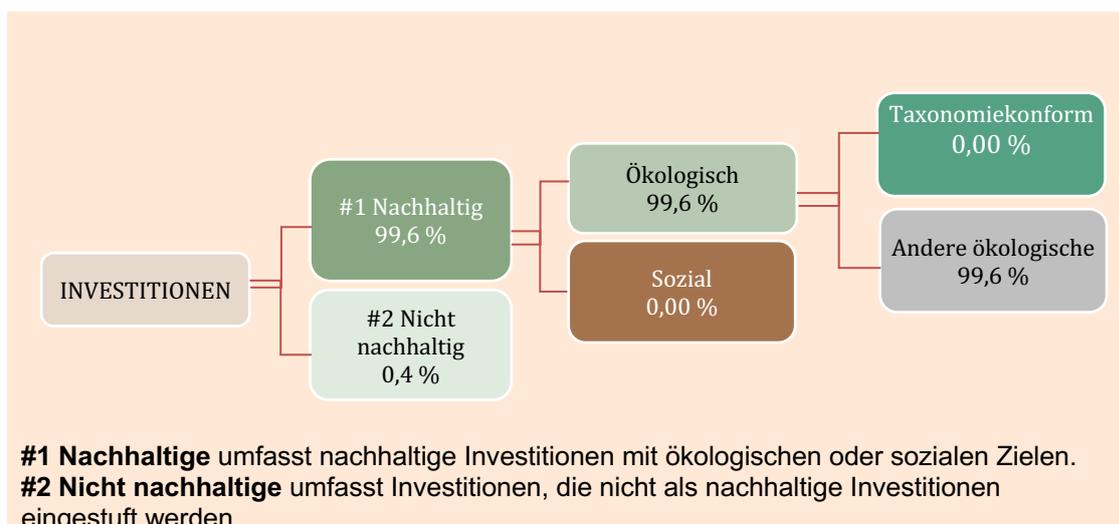


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Fonds hat 99,6% nachhaltige Investitionen, 0,00% EU-Taxonomie konforme Investitionen und 99,6% ökologische, aber nicht EU-Taxonomie konforme Investitionen.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Die nicht nachhaltigen Investitionen bestehen aus 0,4% Kasseninstrumenten, 0,0% Derivate und 0,0% Instrumente ohne ESG-Rating.

Die Messung des Prozentsatzes der Anpassung an die Taxonomie wird erst ab 2023 anwendbar sein.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	In % der Vermögenswerte	Sektor	In % der Vermögenswerte
Staatsanleihen	21,64%	Immobilien	1,86%
Bankwesen	18,24%	Finanzwesen Sonstige	0,76%
Versorger	14,08%	Staatlich gefördert	0,68%
Hypothekensanleihen	9,84%	Energie	0,64%
Supranational	8,64%	Investitionsgüter	0,55%
Strom	7,82%	Zyklische Konsumgüter	0,43%
Staatliche Garantie	6,63%	Cash	0,42%
Lokale Behörden	4,80%	Versicherung	0,31%
Erdgas	2,66%		

Das Gewicht der Investitionen in Unternehmen, die Einkünfte aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, der Herstellung, der Verarbeitung, der Lagerung, der Raffination oder dem Vertrieb, einschließlich Transport, Lagerung und Handel von fossilen Brennstoffen erzielen, beträgt 3,3%.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Auf der Grundlage der verfügbaren Daten wurden 0,0 % an die EU-Taxonomie angeglichen, und zwar gemäß den von den Unternehmen veröffentlichten oder vom Datenanbieter des Managers (MSCI) zur Verfügung gestellten Daten.

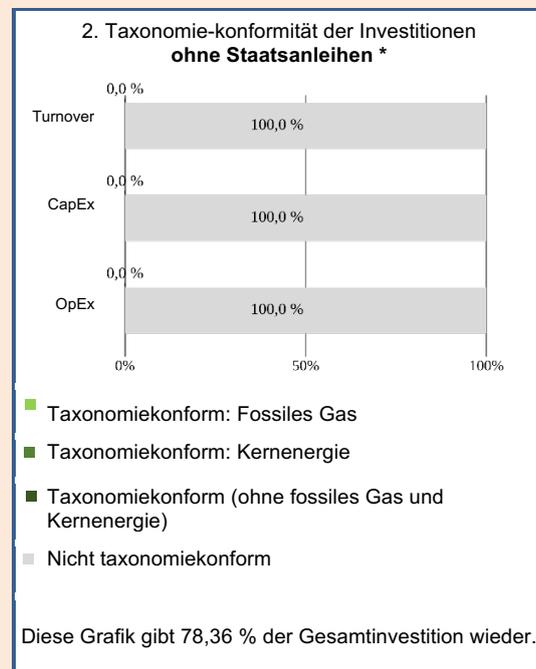
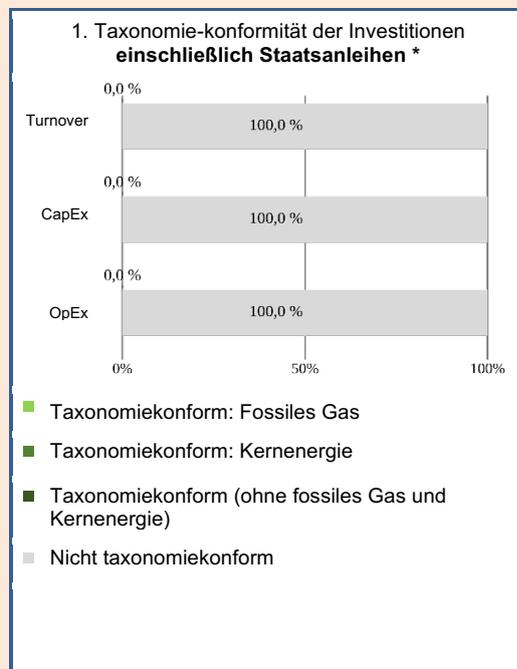
● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

- Ja:
- In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

-**Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
-**Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
-**Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind, ist 0%.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Da kein früherer Bezugszeitraum vorliegt, ist keine vergleichende Angabe möglich.



Sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU)2020/852 **nicht berücksichtigen**.



● **Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?**

Für diese Investition wurden im Jahr 2022 keine an die EU-Taxonomie angepassten Daten gemeldet. Der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel betrug 100,0%



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds hat keine sozial nachhaltigen Investitionen getätigt.



● **Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Dies umfasst Barmittel, Derivate und andere Nebenanlagen. Minimale soziale und ökologische Sicherheitsvorkehrungen wurden angesichts des Profils dieser nicht nachhaltigen Vermögenswerte nicht berücksichtigt. Es gab keine ökologischen und sozialen Schutzmaßnahmen, da diese Investitionen nicht anhand ökologischer oder sozialer Kriterien bewertet werden können.



● **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Das nachhaltige Ziel des Fonds ist es, einen positiven Beitrag zum Klima- und Umweltschutz zu leisten. ODDO BHF Green Bond investiert daher bis zu 100 % seines Vermögens in grüne Anleihen internationaler Emittenten. Green Bonds sind verzinsliche Anleihen, deren Emissionserlöse zur Finanzierung oder Refinanzierung neu-er oder bestehender Umwelt- oder Klimaschutzprojekte verwendet werden. Diese unterstützen den Übergang zu einer kohlenstoffneutralen Wirtschaft. Der Fonds kann auch bis zu 25% seines Vermögens in Nachhaltigkeitsanleihen investieren. Nachhaltigkeitsanleihen sind zinstragende Anleihen, deren Emissionserlöse zur Finanzierung oder Refinanzierung einer Kombination aus grünen und sozialen Projekten verwendet werden.

Wir bevorzugen Nachhaltigkeitsanleihen, die sich auf die Finanzierung grüner Projekte konzentrieren. Im Berichtszeitraum wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

- Die Anleihen wurden einem internen Rechercheprozess zur Überprüfung unterzogen klassifizieren die Einhaltung der Grundprinzipien für Green Bonds
- Darüber hinaus basierte die Einstufung als Green Bond auf Untersuchungen von Bloomberg MSCI unter Anwendung der Green Bond Principles (GBP) der International Capital Market Association (ICMA).
- Wir haben Green Bonds priorisiert, die sich auf die Finanzierung grüner Projekte konzentrieren.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Bei der Auswahl der Anlagetitel wird sich am Bloomberg MSCI Euro Green Bond TR Index orientiert. Der Index wird jedoch nicht reproduziert, und stellt für diesen Fonds keinen ESG-Referenzindex dar.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzproduktes erreicht wird.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Die Konstituenten des vorgenannten Index werden auf Basis von MSCI ESG Research ausgewählt, um sicherzustellen, dass die Schuldverschreibungen des Index einen echten Einfluss auf Umweltprojekte haben. MSCI ESG Research analysiert daher die Verwendung der Erlöse, die Projektbewertung, das Management der Erlöse und die Berichterstattung der Wertpapiere, um die Eignung für den Index sicherzustellen. Der Investmentprozess integriert die Analysen von MSCI ESG Research, welche auch dem Index zugrunde liegen. Die Zusammensetzung des Index basiert auf einer eingehenden Analyse durch den Indexprovider. Er ist vollständig auf die ökologischen Ziele des Fonds ausgerichtet und unterscheidet sich daher von einem breiten Marktindex für Schuldverschreibungen.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?**

Der oben genannte Index stellt keine ESG Benchmark dar.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der oben genannte Index stellt keine ESG Benchmark dar.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Der oben genannte Index stellt keine ESG Benchmark dar.

Düsseldorf, den 6. November 2023

ODDO BHF Asset Management GmbH
Die Geschäftsführung

VERMERK DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS

An die ODDO BHF Asset Management GmbH, Düsseldorf

Prüfungsurteil

Wir haben den Jahresbericht nach § 7 KARBV des Sondervermögens ODDO BHF Green Bond - bestehend aus dem Tätigkeitsbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023, der Vermögensübersicht und der Vermögensaufstellung zum 30. September 2023, der Ertrags- und Aufwandsrechnung, der Verwendungsrechnung, der Entwicklungsrechnung für das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023 sowie der vergleichenden Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre, der Aufstellung der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und dem Anhang - geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der beigefügte Jahresbericht nach § 7 KARBV in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuchs (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglicht es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt «Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV» unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der ODDO BHF Asset Management GmbH (im Folgenden die «Kapitalverwaltungsgesellschaft») unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht nach § 7 KARBV zu dienen.

Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die Publikation Jahresbericht - ohne weitergehende Querverweise auf externe Informationen-, mit Ausnahme des geprüften Jahresberichts nach § 7 KARBV sowie unseres Vermerks.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht nach § 7 KARBV erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung haben wir die Verantwortung, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen

- wesentliche Unstimmigkeiten zum Jahresbericht nach § 7 KARBV oder unseren bei der Prüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht nach § 7 KARBV

Die gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft sind verantwortlich für die Aufstellung des Jahresberichts nach § 7 KARBV, der den Vorschriften des deutschen KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entspricht und dafür, dass der Jahresbericht nach § 7 KARBV es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie in Übereinstimmung mit diesen Vorschriften als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung eines Jahresberichts nach § 7 KARBV zu ermöglichen, der frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern ist.

Bei der Aufstellung des Jahresberichts nach § 7 KARBV sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung des Sondervermögens wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet unter anderem, dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung des Jahresberichts nach § 7 KARBV die Fortführung des Sondervermögens durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung des Sondervermögens, sofern einschlägig, anzugeben.

Die gesetzlichen Vertreter sind auch verantwortlich für die Darstellung der nachhaltigkeitsbezogenen Angaben im Anhang in Übereinstimmung mit dem KAGB, der Verordnung (EU) 2019/2088, der Verordnung (EU) 2020/852 sowie der diese konkretisierenden Delegierten Rechtsakte der Europäischen Kommission, und mit den von den gesetzlichen Vertretern dargestellten konkretisierenden Kriterien. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie als notwendig erachtet haben, um die nachhaltigkeitsbezogenen Angaben zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der nachhaltigkeitsbezogenen Angaben) oder Irrtümern sind.

Die oben genannten europäischen Vorschriften enthalten Formulierungen und Begriffe, die erheblichen Auslegungsunsicherheiten unterliegen und für die noch keine maßgebenden umfassenden Interpretationen veröffentlicht wurden. Demzufolge haben die gesetzlichen Vertreter im Anhang ihre Auslegungen solcher Formulierungen und Begriffe angegeben. Die gesetzlichen Vertreter sind verantwortlich für die Vertretbarkeit dieser Auslegungen. Da solche Formulierungen und Begriffe unterschiedlich durch Regulatoren oder Gerichte ausgelegt werden können, ist die Gesetzmäßigkeit dieser Auslegungen unsicher.

Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresbericht nach § 7 KARBV als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zum Jahresbericht nach § 7 KARBV beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresberichts nach § 7 KARBV getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern im Jahresbericht nach § 7 KARBV, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.

- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung des Jahresberichts nach § 7 KARBV relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Kapitalverwaltungsgesellschaft abzugeben.

- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Kapitalverwaltungsgesellschaft bei der Aufstellung des Jahresberichts nach § 7 KARBV angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.

- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung des Sondervermögens durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben im Jahresbericht nach § 7 KARBV aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass das Sondervermögen durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft nicht fortgeführt wird.

- beurteilen wir Darstellung, Aufbau und Inhalt des Jahresberichts nach § 7 KARBV insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob der Jahresbericht nach § 7 KARBV die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass der Jahresbericht nach § 7 KARBV es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglicht, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen des Sondervermögens zu verschaffen.

- beurteilen wir die Eignung der von den gesetzlichen Vertretern zu den nachhaltigkeitsbezogenen Angaben erfolgten konkretisierenden Auslegungen insgesamt. Wie im Abschnitt „Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht nach § 7 KARBV“ dargelegt, haben die gesetzlichen Vertreter die in den einschlägigen Vorschriften enthaltenen Formulierungen und Begriffe ausgelegt; die Gesetzmäßigkeit dieser Auslegungen ist wie im Abschnitt „Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für den Jahresbericht nach § 7 KARBV“ dargestellt mit inhärenten Unsicherheiten behaftet. Diese inhärenten Unsicherheiten bei der Auslegung gelten entsprechend auch für unsere Prüfung.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen unter anderem den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Düsseldorf, den 9. Januar 2024

PricewaterhouseCoopers GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Andre Hütig
Wirtschaftsprüfer

ppa. Markus Peters
Wirtschaftsprüfer

Kurzübersicht über die Partner des ODDO BHF Green Bond

ODDO BHF Asset Management GmbH

Herzogstraße 15
40217 Düsseldorf
Postanschrift:
Postfach 10 53 54, 40044 Düsseldorf
Telefon: +49 (0) 211 2 39 24-01

Zweigstelle Frankfurt am Main
Gallusanlage 8
60329 Frankfurt am Main
Postanschrift:
Postfach 11 07 61, 60042 Frankfurt am Main
Telefon: +49 (0) 69 9 20 50-0
Telefax: +49 (0) 69 9 20 50-103

Gezeichnetes und eingezahltes Eigenkapital:
10,3 Mio. EUR

Gesellschafter von ODDO BHF Asset Management GmbH
ist zu 100% die ODDO BHF SE

VERWAHRSTELLE

The Bank of New York Mellon SA/NV
Asset Servicing, Niederlassung Frankfurt am Main
MesseTurm, Friedrich-Ebert-Anlage 49
60327 Frankfurt am Main

Haftendes Kern- und Ergänzungskapital:
3,3 Mrd. EUR

GESCHÄFTSFÜHRUNG

Nicolas Chaput

Sprecher
Zugleich Präsident der ODDO BHF
Asset Management SAS und der
ODDO BHF Private Equity SAS

Dr. Stefan Steuerer

Bastian Hoffmann

Zugleich Mitglied des Verwaltungsrats der
ODDO BHF Asset Management Lux

AUFSICHTSRAT

Werner Taiber

Vorsitzender
Düsseldorf, Vorsitzender des Aufsichtsrats der
ODDO BHF SE, Frankfurt am Main

Grégoire Charbit

Paris, Vorstand der ODDO BHF SE,
Frankfurt am Main und ODDO BHF SCA, Paris

Christophe Tadié

Frankfurt am Main, Vorstand der ODDO BHF SE und
ODDO BHF SCA, Vorsitzender des Vorstands (CEO)
der ODDO BHF Corporates & Markets AG

Joachim Häger

Friedrichsdorf, Vorstand der ODDO BHF SE, Frankfurt am Main
und der ODDO BHF SCA, Paris, Präsident des Verwaltungsrats der
ODDO BHF (Schweiz) AG, Zürich

Michel Haski

Lutry, Unabhängiger Aufsichtsrat

Olivier Marchal

Suresnes, Vorsitzender von Bain & Company France und
Vorsitzender des Aufsichtsrats der ODDO BHF SCA, Paris

Monika Vicandi

Triesenberg, Vorstand der ODDO BHF SE, Frankfurt am Main

Alle Angaben Stand Januar 2024

ODDO BHF Asset Management GmbH

Herzogstraße 15
40217 Düsseldorf
Postanschrift:
Postfach 10 53 54
40044 Düsseldorf

Zweigstelle Frankfurt am Main
Gallusanlage 8
60329 Frankfurt am Main
Postanschrift:
Postfach 11 07 61
60042 Frankfurt am Main
Telefon +49 (0) 69 9 20 50 - 0
Telefax +49 (0) 69 9 20 50 - 103

am.oddo-bhf.com



ODDO BHF
ASSET MANAGEMENT